

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
送出日期:2011年8月25日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示  
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及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责任。本半年度报告已经本基金托管人同意,并由董事长签发。  
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月19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。  
本报告财务资料未经审计。  
本报告自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

**§2 基金简介**

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 泰达宏利货币          |
| 基金代码       | 162206          |
| 基金运作方式     | 契约开放式           |
| 基金合同生效日    | 2005年11月10日     |
| 基金管理人      | 泰达宏利基金管理有限公司    |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 180,726,331.67份 |
| 基金合同存续期    | 持续经营            |

**§2 基金产品说明**

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在确保本金安全性和基金资产流动性的基础上,力争为投资者获取超过业绩比较基准的收益。   |
| 投资策略   | 本基金将在遵守证券法律法规并有效管理风险的基础上,主要依据的投资风格和价值的交易操作,以价值分析为基础,数量分析为支持,采用自上而下确定投资范围和自下而上个股选择程序,运用基本面分析、中期策略、收益率曲线配置和类属配置等积极投资策略,实现基金资产的保值增值。 |
| 业绩比较基准 | 税后一年期银行定期存款利率。  |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高风险、低流动性的品种,其预期收益水平和风险程度均低于股票、混合和债券型基金。   |

**§3 主要财务指标和基金净值表现**

|               |                           |
|---------------|---------------------------|
| 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) |
| 本期已实现收益       | 3,806,330.78              |
| 本期利润          | 3,806,330.78              |
| 本期净收益         | 1,356.85                  |
| 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      | 180,726,331.67            |
| 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.所述基金业绩指标不包括基金份额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。  
3.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         | 份额净值增长率① | 业绩比较基准收益率② | ①-②      | ①-③     | ②-④      |
|------------|----------|------------|----------|---------|----------|
| 过去一个月      | 0.2395%  | 0.0026%    | 0.2671%  | 0.0000% | -0.0276% |
| 过去三个月      | 0.6227%  | 0.0024%    | 0.8608%  | 0.0002% | -0.1841% |
| 过去六个月      | 1.3568%  | 0.0026%    | 1.5199%  | 0.0008% | -0.1631% |
| 过去一年       | 2.3635%  | 0.0042%    | 2.7082%  | 0.0011% | -0.3247% |
| 过去三年       | 6.3530%  | 0.0055%    | 7.8853%  | 0.0016% | -1.5323% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.4173% | 0.0061%    | 14.7678% | 0.0020% | -1.3505% |

注:1.本基金收益分配按月结转份额。  
2.本基金的上列比较基准为税后一年期银行定期存款利率。  
3.2.2 自基金合同成立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

注:本基金成立于2005年11月10日,在建仓期结束时截止报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

**§4 管理人报告**

4.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.1.1 基金管理人  
泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司,湘财恒银基金管理有限公司,泰达恒银基金管理有限公司,成立于2002年6月6日,是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为:北方国际信托股份有限公司,51%;宏利资产管理(香港)有限公司,49%。  
目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利蓝筹价值混合型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中盘股票型证券投资基金、泰达宏利领先大盘股票型证券投资基金在内的十五只证券投资基金。  
4.1.2 基金经理 魏斌基金小组 及基金经理助理简期

| 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  |
|----|---------|-----------------|--------|---|
| 魏斌 | 本基金基金经理 | 2008年8月9日 -     | 8      | 硕士学位,2003年7月至2005年4月就职于鲁证证券有限责任公司,从事债券发行与研究,2006年3月至2006年6月就职于国联证券分公司,从事债券发行工作,2006年7月至2008年3月就职于泰达宏利基金管理有限公司,其中2006年7月至2006年11月任泰达宏利货币基金经理助理,2006年12月至2008年3月任泰达宏利货币基金经理,2008年4月加盟泰达宏利基金管理有限公司,8年证券从业经验,5年基金从业经验,具有基金从业资格。 |

注: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相关法律法规及基金合同的约定,本基金运作整体合法合规,没有出现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  
本基金管理人建立了公平交易制度和流程,并严格执行制度的规定,在投资管理活动中,本基金管理人公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会;严格执行投资管理职能和交易执行的隔离;在交易环节实行集中交易制度,并确保公平交易可操作,可稽核,可追溯;交易部运用交易系统设置的投资公平功能并严格按照优先、价格优先的原则严格执行所有指令,未发生任何利益输送的情况。  
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  
本公司旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。  
4.3.3 异常交易行为的专项说明  
本基金管理人建立了异常交易行为的控制制度,在本报告期内未发生异常交易而受到监管机构处罚的情况。  
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  
2011年上半年,由于次贷危机、日本地震等不利因素的冲击,世界经济整体表现不佳,美、日、欧等主要经济体经济增长低于预期,量化宽松政策或维持持续,通胀压力大增。  
国内,增长略低于预期,但通胀压力持续扩大,宏观调控政策控制持续紧张,整个上半年,央行维持每个月上调存款准备金率1次的频率,并上调了2次基准利率,同时大幅提高逆回购操作维持较大力度。  
受央行持续上调流动性的影响,上半年货币市场利率大幅波动,先是年末因素叠加春节长假因素对银行间市场短期利率的冲击到了近年来的高点,1个月、3个月短期利率持续维持在8%以上的高位。进入6月中下旬以来,尽管央行向市场注入大量资金,但回购利率长时间维持在7%以上的高位。3月初6月中旬,市场利率维持相对较为宽松的情形。  
受资金面大幅波动影响,除shibor涨幅波动表现很意外,短债收益率整体震荡上行,1年内央票、金融债到4%附近水平,远高于1年定存利率和公开市场操作利率,中低信用等级债利差向上幅度则更大许多。  
操作上,本基金相对比较谨慎,协议存款、短债的shibor波动是基金配置的重点,5月央行后对市场资金宽松状况估计不足,错过一些较好的投资机会。从目前的情况看,3季度的投资机会集中在短债和shibor波动及由于前期资金偏紧造成的高评级短债及金融债,资金、票面的阶段性改善将会使得货币市场利率和偏高的短债收益率出现较大的回落。  
4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
截止报告期末,本基金份额净值为1.0000元,本报告期份额净值增长率为1.3568%,同期业绩比较基准增长率为1.5199%。  
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的高要展望  
展望2011年下半年,尽管经济增长在整体水平较高的基础上出现短期回落,通胀形势总体可控,但总体水平短期依然会维持较高的水平,可以预见政策基调不会发生太大改变,下半年依然存在加息和上调准备金率的可能,另外,考虑到去年以来多次上调准备金的累积效应和商业银行存贷比日均考核的影响,下半年资金的宽松程度会弱于2季度,货币市场利率水平将整体抬高,受冲击时也将更艰难,策略上,短期债券收益率在6月底已经调整较为充分,高评级短债及部分央票、金融债投资价值良好,近期准备积极增持,临近3季度末,市场利率可能将重归去年以来的季末调整,策略上将转为谨慎。  
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明  
根据中国证券监督管理委员会2008年9月2日发布的《2008》38号文关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见,为相关规定,本公司成立长期停牌股票没有市价的估值委员会,成员由基金运营部的副总经理、督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员组成,职责分工、专业胜任能力和相关工作程序具体如下:  
主管基金运营的副总经理担任估值委员会主任,督察长、投资总监担任副主任,主要负责估值委员会的组织、管理工作,并对涉及估值委员会的重大事项做出决策。

**§5 托管人报告**

中国农业银行股份有限公司(以下简称“托管人”)根据《泰达宏利货币市场基金基金合同》、《泰达宏利货币市场基金托管协议》的约定,对泰达宏利货币市场基金管理人泰达宏利基金管理有限公司2011年1月1日至2011年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。  
5.2 托管人对报告期内本基金投资遵规守信情况的说明  
本托管人认为,泰达宏利基金管理有限公司在泰达宏利货币市场基金的投资运作,基金资产净值的计算,基金份额申购赎回价格的计算,基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。  
5.3 托管人对半度度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见  
5.4 托管人认为,泰达宏利基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的泰达宏利货币市场基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现损害基金份额持有人利益的行为。

**§6 半年度财务报表 (未经审计)**

单位:人民币元

| 资产        | 本报告期末<br>2011年6月30日 | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|-----------|---------------------|---------------------|
| 货币资金      | 672,708.04          | 50,308,914.05       |
| 银行存款      | -                   | 409,090.91          |
| 存出保证金     | -                   | -                   |
| 交易性金融资产   | 130,146,081.56      | 220,449,163.03      |
| 其中:股票投资   | -                   | -                   |
| 基金投资      | -                   | -                   |
| 债券投资      | 130,146,081.56      | 220,449,163.03      |
| 资产支持证券投资  | -                   | -                   |
| 衍生金融资产    | -                   | -                   |
| 买入返售金融资产  | 60,000,330.00       | 171,000,570.00      |
| 应收证券清算款   | -                   | -                   |
| 应收利息      | 1,677,689.94        | 1,449,318.46        |
| 应收股利      | -                   | -                   |
| 应收申购款     | 147,973.66          | 60,999,896.92       |
| 递延所得税资产   | -                   | -                   |
| 其他资产      | -                   | -                   |
| 资产总计      | 192,644,783.20      | 504,616,953.37      |
| 负债和所有者权益  |                     |                     |
| 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 | 11,269,874.36       | 28,999,785.50       |
| 应付证券清算款   | -                   | -                   |
| 应付赎回款     | -                   | -                   |
| 应付管理人报酬   | 52,708.19           | 118,826.51          |
| 应付托管费     | 19,972.15           | 36,008.06           |
| 应付销售服务费   | 39,930.41           | 90,020.12           |
| 应付交易费用    | 15,798.37           | 14,900.99           |
| 应付税费      | 51,399.84           | -                   |
| 应付利息      | 1,654.04            | 3,644.86            |
| 递延所得税负债   | -                   | -                   |
| 其他负债      | 182,947.22          | 364,500.00          |
| 负债合计      | 11,918,451.63       | 30,174,035.24       |
| 所有者权益:    |                     |                     |
| 实收基金      | 180,726,331.67      | 474,442,918.13      |
| 未分配利润     | 180,726,331.67      | 474,442,918.13      |
| 所有者权益合计   | 192,644,783.20      | 504,616,953.37      |

注:报告期末止日2011年6月30日,基金份额净值1.00元,基金份额总额180,726,331.67份。  
6.2 利润表  
单位:人民币元

| 项目                  | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入                | 5,261,656.14               | 16,471,374.52                   |
| 1.利息收入              | 5,250,041.85               | 13,224,240.42                   |
| 其中:存款利息收入           | 650,232.49                 | 5,999,940.44                    |
| 债券利息收入              | 2,867,993.83               | 7,410,502.94                    |
| 资产支持证券利息收入          | -                          | -                               |
| 买入返售金融资产收入          | 1,731,815.53               | 813,797.04                      |
| 其他利息收入              | -                          | -                               |
| 2.投资收益(损失以“-”号填列)   | 11,614.29                  | 2,747,134.10                    |
| 债券投资收益              | -                          | -                               |
| 基金投资收益              | -                          | -                               |
| 资产支持证券投资收益          | -                          | -                               |
| 衍生工具收益              | -                          | -                               |
| 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -                          | -                               |
| 4.其他收益(损失以“-”号填列)   | -                          | -                               |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)   | -                          | -                               |
| 减:二、费用              | 1,455,325.36               | 5,333,995.87                    |
| 1.管理人报酬             | 447,380.64                 | 2,299,976.23                    |
| 2.托管费               | 138,600.07                 | 696,962.52                      |
| 3.销售服务费             | 346,500.00                 | 1,742,406.11                    |
| 4.交易费用              | 325,216.97                 | 407,113.79                      |
| 5.利息支出              | 325,216.97                 | 407,113.79                      |
| 其中:卖出回购金融资产支出       | 187,627.22                 | 187,537.22                      |
| 6.其他费用              | 187,627.22                 | 187,537.22                      |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 3,806,330.78               | 11,137,378.65                   |
| 四、净利润(净收益以“-”号填列)   | 3,806,330.78               | 11,137,378.65                   |

**§7 所有者权益(基金净值)变动表**

单位:人民币元

| 项目                                      | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|----------------------------|---------------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                         | 474,442,918.13             | 474,442,918.13                  |
| 二、本期增减变动金额(本期利润)                        | 3,806,330.78               | 3,806,330.78                    |
| 三、本期基金份额总额产生的基金净值变动数(本期申购)              | -                          | -                               |
| 其中:基金申购款                                | -293,716,586.46            | -293,716,586.46                 |
| 基金赎回款                                   | -                          | -                               |
| 2.基金赎回款                                 | 555,109,830.29             | 555,109,830.29                  |
| 3.基金转换转入                                | -848,826,416.75            | -848,826,416.75                 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净收益分配以“-”号填列) | -                          | -3,806,330.78                   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                         | 180,726,331.67             | 180,726,331.67                  |

**§8 关联方交易**

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:泰达宏利货币市场基金  
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

| 项目                                      | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|----------------------------|---------------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                         | 474,442,918.13             | 474,442,918.13                  |
| 二、本期增减变动金额(本期利润)                        | 3,806,330.78               | 3,806,330.78                    |
| 三、本期基金份额总额产生的基金净值变动数(本期申购)              | -                          | -                               |
| 其中:基金申购款                                | -293,716,586.46            | -293,716,586.46                 |
| 基金赎回款                                   | -                          | -                               |
| 2.基金赎回款                                 | 555,109,830.29             | 555,109,830.29                  |
| 3.基金转换转入                                | -848,826,416.75            | -848,826,416.75                 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净收益分配以“-”号填列) | -                          | -3,806,330.78                   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                         | 180,726,331.67             | 180,726,331.67                  |

**§9 投资组合报告**

6.4.1 报告期末基金资产组合情况

| 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例(%) |
|-------------------|----------------|--------------|
| 1. 固定收益投资         | 130,146,081.56 | 67.56        |
| 其中:债券             | 130,146,081.56 | 67.56        |
| 资产支持证券            | -              | -            |
| 2. 买入返售金融资产       | 60,000,330.00  | 31.15        |
| 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   | 672,708.04     | 0.35         |
| 4. 其他各项资产         | 1,825,663.60   | 0.95         |
| 5. 合计             | 192,644,783.20 | 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            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------------|---------------|--------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 7,200         | -            |
|    | 其中:买断式回购融资   | -             | -            |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 11,269,874.36 | 6.24         |
|    | 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。债券回购融资余额超过基金资产净值20%的说明

| 序号 | 发生日期       | 融资金额占基金资产净值比例(%) | 原因   | 调整期 |
|----|------------|------------------|------|-----|
| 1  | 2011年4月27日 | 26.57            | 大额赎回 | 1天  |
| 2  | 2011年5月24日 | 23.99            | 大额赎回 | 1天  |

7.3 基金投资运作平均余额期限  
7.3.1 投资组合平均余额期限分布情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均余额期限    | 105 |
| 报告期内投资组合平均余额期限最高值 | 176 |
| 报告期内投资组合平均余额期限最低值 | 92  |

报告期内投资组合平均余额期限超过180天情况说明  
报告期内投资组合平均余额期限未出现超过180天的情况。  
7.3.2 期末投资组合平均余额期限分布比例

| 序号 | 平均余额期限                | 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                 | 39.11              | 6.24               |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)-60天            | 11.14              | -                  |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                  | -                  |
| 3  | 60天(含)-90天            | -                  | -                  |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                  | -                  |
| 4  | 90天(含)-180天           | 33.19              | -                  |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                  | -                  |
| 5  | 180天(含)-397天(含)       | 22.14              | -                  |
|    | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                  | -                  |
| 合计 |                       | 105.58             | 6.24               |

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               | 70,122,366.11  | 38.80        |
|    | 其中:政策性金融债          | 49,984,518.54  | 27.66        |
| 4  | 企业债券               | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券            | 60,023,715.45  | 33.21        |
| 6  | 中期票据               | -              | -            |
| 7  | 其他                 | -              | -            |
| 8  | 合计                 | 130,146,081.56 | 72.01        |
| 9  | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -              | -            |

注:报告期的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。  
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  | 100226  | 10国开26   | 500,000 | 49,984,518.54 | 27.66        |
| 2  | 1020001 | 10三夏银01  | 200,000 | 20,137,847.57 | 11.14        |
| 3  | 1181082 | 11银利CP02 | 100,000 | 10,012,232.26 | 5.54         |
| 4  | 1081362 | 10国开07   | 100,000 | 10,004,588.90 | 5.54         |
| 5  | 1181274 | 11国电CP   | 100,000 | 10,003,080.90 | 5.53         |
| 6  | 1181150 | 11北车CP01 | 100,000 | 10,002,427.34 | 5.53         |
| 7  | 1081232 | 10天华CP01 | 100,000 | 10,001,034.04 | 5.53         |
| 8  | 1181198 | 11河钢CP02 | 100,000 | 10,000,380.92 | 5.53         |

7.6 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离  
金额单位:人民币元

| 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 | 6        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0262%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.3254% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.1144%  |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细  
报告期末本基金未持有资产支持证券。  
7.8 投资组合报告附注  
7.8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价时以买入成本列示,按票面利率或约定利率每日计提利息,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,本基金没有持有剩余期限小于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其公允价值20%的情况。  
7.8.3 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。  
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    | 1,677,689.94 |
| 4  | 应收申购款   | 147,973.66   |
| 5  | 其他应收款   | -            |
| 6  | 待摊费用    | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,825,663.60 |

7.9 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
7.9.由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。  
7.10 报告期内没有需要说明的证券投资决策程序。  
§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) | 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        |
| 8,097    | 20,780.31 | 111,650,715.73 | 61,786 | 69,075,615.94 |
|          |           |                |        | 38.22%        |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况  
金额单位:人民币元

| 项目                  | 持有份额总数(份)  | 占基金总份额比例 |
|---------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本开放式基金 | 135,918.45 | 0.0752%  |

§9 开放式基金份额变动  
单位:份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2005年11月10日)基金份额总额 | 4,643,264,492.55 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 474,442,918.13   |
| 本报告期基金总申购份额                | 555,109,830.29   |
| 减:本报告期基金总赎回份额              | 848,826,416.75   |
| 本报告期末基金份额总额                | 180,726,331.67   |

§10 重大事件揭示  
10.1