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:2017年8月28日

诺安货币市场基金

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年8月25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。

本半年度报告摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2017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	诺安货币	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	1,310,684,752.35份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安货币A	诺安货币B
下属分级基金的交易代码:	320002	320019
报告期末下属分级基金的份额总额	527,619,134.33份	783,065,618.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的安全性和资产的流动性,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资金市场供求情况,判断短期利率的走势,进行自上而下的整体资产策略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方面进行主动式选择。
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,风险低并且收益稳定。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	邓明
	联系电话	0755-83026688	(010)66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	(010)66105798

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.lionfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层 诺安基金管理有限公司

§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	诺安货币A	诺安货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日-2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日-2017年6月30日)
本期已实现收益	3,904,059.43	44,936,036.90
本期利润	3,904,059.43	44,936,036.90
本期净值收益率	1.6977%	1.8179%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末基金资产净值	527,619,134.33	783,065,618.02
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:① 本基金的利润分配方式是 每日分配,按月支付"。

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 自2012年2月21日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,详情请参阅相关公告。

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

诺安货币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	0.3451%	0.0052%	0.0292%	0.0000%	0.3159%	0.0052%
过去三个月	0.9397%	0.0051%	0.0885%	0.0000%	0.8512%	0.0051%
过去六个月	1.6977%	0.0047%	0.1760%	0.0000%	1.5217%	0.0047%
过去一年	2.9300%	0.0040%	0.3549%	0.0000%	2.5751%	0.0040%
过去三年	9.9925%	0.0054%	1.0656%	0.0000%	8.9269%	0.0054%
自基金合同生效起至今	43.7212%	0.0052%	5.7203%	0.0003%	38.0009%	0.0049%

诺安货币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	0.3642%	0.0052%	0.0292%	0.0000%	0.3350%	0.0052%
过去三个月	0.9994%	0.0051%	0.0885%	0.0000%	0.9109%	0.0051%
过去六个月	1.8179%	0.0047%	0.1760%	0.0000%	1.6419%	0.0047%
过去一年	3.1756%	0.0040%	0.3549%	0.0000%	2.8207%	0.0040%
过去三年	10.7863%	0.0054%	1.0656%	0.0000%	9.7207%	0.0054%
自基金合同生效起至今	21.6541%	0.0049%	1.9515%	0.0001%	19.7026%	0.0048%

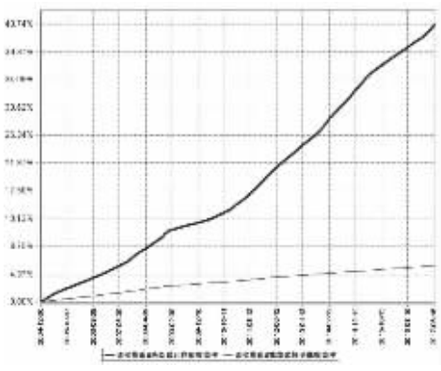
注:①本基金的利润分配方式是 每日分配,按月支付"。

② 本基金的业绩比较基准为:当期银行个人活期储蓄利率(税后)。

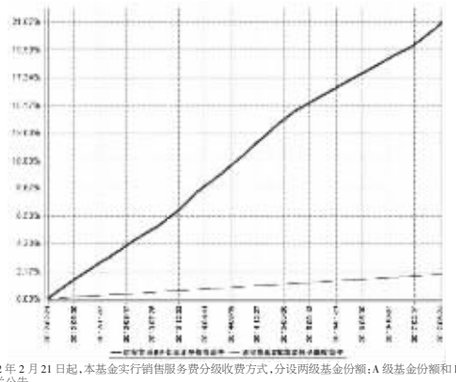
③自2012年2月21日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额;其中B级基金份额的指标计算自分级实施日(2012年2月21日)开始起。

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

诺安货币A



诺安货币B



注:自2012年2月21日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,详情请参阅相关公告。

§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

截至2017年6月30日,本基金管理人共管理52只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金等。

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		
谢志华	固定收益事业部副总经理、总裁助理,诺安纯债定期开放债券基金经理、诺安鸿鑫保本混合基金经理、诺安优化收益债券基金经理、诺安汇鑫保本混合基金经理、诺安聚利债券基金经理、诺安利鑫保本混合基金经理、诺安景鑫保本混合基金经理、诺安益鑫保本混合基金经理、诺安安鑫保本混合基金经理、诺安理财宝货币基金经理、诺安聚鑫宝货币基金经理、诺安货币基金经理、诺安和鑫保本混合基金经理、诺安行业轮动混合基金经理。	2016年2月20日	-	11	理学硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于华泰证券有限责任公司、招商基金管理有限公司,从事固定收益类品种的研究、投资工作。曾于2010年8月至2012年8月任招商安心收益债券基金经理,2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券基金经理。2012年8月加入诺安基金管理有限公司,任投资经理,现任固定收益事业部副总经理、总裁助理。2013年11月至2016年2月任诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理,2015年3月至2016年2月任诺安裕鑫收益两年定期开放债券基金经理,2013年6月至2016年3月任诺安信用债券一年定期开放债券基金经理,2014年6月至2016年3月任诺安永鑫收益一年定期开放债券基金经理,2013年8月至2016年3月任诺安稳固收益一年定期开放债券基金经理,2014年11月至2017年6月任诺安保本混合基金经理。2013年5月起任诺安鸿鑫保本混合及诺安纯债定期开放债券基金经理,2013年12月起任诺安优化收益债券基金经理,2014年11月起任诺安汇鑫保本混合及诺安聚利债券基金经理,2015年12月起任诺安和鑫保本混合及诺安景鑫保本混合基金经理,2016年1月起任诺安益鑫保本混合基金经理,2016年2月起任诺安安鑫保本混合、诺安理财宝货币、诺安聚鑫宝货币及诺安货币基金经理,2016年4月起担任诺安和鑫保本混合基金经理,2017年6月起任诺安行业轮动混合基金经理。
岳帅	诺安货币市场证券投资基金基金经理	2016年9月6日	-	7	本科,具有基金从业资格。曾就职于红塔证券股份有限公司及银河期货有限公司,任客户经理;后就职于平安利顺货币经纪有限公司,任交易员。2013年4月加入诺安基金管理有限公司,任债券交易员,从事债券交易工作。2016年9月起担任诺安货币市场证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

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》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安货币市场基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心,公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%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

本基金在以流动性管理作为重点的同时努力提高收益。相机抉择增加短融、存单配置,灵活进行逆回购和存款运作,在流动性的关键时点,安排相应的资金到期,使资产保持较强的流动性,以满足投资者日常的申购、赎回需求。

管理人始终坚持"保本金的安全性、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"的原则,注重信用风险的控制,严格执行内部债券评级制度,确保资产的安全性。在投资管理过程中,注重控制投资、交易及操作风险,对基金资产进行合理配置。

央行货币政策仍将维持稳健中性,资金面表现为紧平衡,波动性会比较大,管理人将继续灵活进行逆回购和存款操作,在保证资产的流动性和安全性的基础上,秉持债券分散化投资的原则,通过动态调整债券资产比例,释放收益,为投资者创造更高的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金份额组合的剩余期限为83天,影子定价偏离度为0.1242%。本报告期诺安货币A基金份额净值收益率为1.6977%,诺安货币A的同期业绩比较基准收益率为0.1760%;诺安货币B基金份额净值收益率为1.8179%,诺安货币B的同期业绩比较基准收益率为0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上半年已公布的经济数据来看,经济基本面保持平稳,通胀水平也有温和复苏迹象,展望下半年,国内经济运行大概率仍将保持平稳运行,在"防风险、去杠杆"总基调和监管逐步加强的背景下,央行维持中性偏紧的货币政策氛围的动力较强。

外围市场经济复苏和通胀也开始抬头,美联储和欧央行货币政策预计将逐步收紧,加上美联储已经开始讨论缩表,其对全球市场的流动性的冲击将在未来一段时间逐步显现,四季度资金面存在较大的不确定性,具体资金面情况需关注央行货币政策可操作的力度和态度。

因此,未来仍以谨慎操作为主,管理人将根据市场节奏合理安排流动性和配置。

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《证券投资基金会计准则》、《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与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,并由研究部、财务综合部、监察稽核部、风险控制部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组,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,本基金未签约与估值相关的定价服务。

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"。本基金本期实现利润为48,840,096.33元,应分配利润48,840,096.33元,已实施利润分配48,840,096.33元,符合本基金合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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,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规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,诺安货币市场基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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2017年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合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:2017年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产:		
银行存款	221,808,705.32	1,500,896,047.85
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,089,942,396.30	2,799,791,136.59
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,089,942,396.30	2,799,791,136.59
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	67,000,500.50	2,587,366,161.04
应收证券清算款	40,778,706.85	-
应收利息	4,416,955.23	42,051,922.90
应收股利	-	-
应收申购款	82,598,761.63	199,799,846.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	20,168.30	-
资产总计	1,506,566,194.13	7,129,905,114.75
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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	192,699,470.95	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	229,983.16	111,676.83
应付管理人报酬	426,072.92	2,081,398.86
应付托管费	129,113.00	630,726.92
应付销售服务费	91,679.15	96,813.61
应付交易费用	60,749.17	97,810.73
应交税费	417,600.00	417,600.00
应付利息	25,251.78	-
应付利润	1,601,804.64	4,589,772.09
递延所得税负债	-	-
其他负债	199,717.01	179,050.12
负债合计	195,881,441.78	8,204,849.16
所有者权益:		
实收基金	1,310,684,752.35	7,121,700,265.59
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,310,684,752.35	7,121,700,265.59
负债和所有者权益总计	1,506,566,194.13	7,129,905,114.75

注:报告截止日2017年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,310,684,752.35份,其中,诺安货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额527,619,134.33份;诺安货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额783,065,618.02份。

6.2 利润表

会计主体:诺安货币市场基金

本报告期:2017年1月1日至2017年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	57,447,047.56	211,038,125.71
1.利息收入	55,678,353.09	186,351,664.54
其中:存款利息收入	10,233,062.36	110,754,303.69
债券利息收入	23,268,910.07	64,653,164.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	22,176,380.66	10,944,196.77
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,768,694.47	24,686,461.17
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,768,694.47	24,686,461.17
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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)	-	-
减:二、费用	8,606,951.23	36,366,849.70
1.管理人报酬	4,838,699.97	21,582,727.31
2.托管费	1,466,272.75	6,540,220.30
3.销售服务费	409,287.76	871,765.86
4.交易费用	619.70	-
5.利息支出	1,651,555.08	7,140,560.43
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	240,515.97	231,575.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	48,840,096.33	174,671,276.01
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	48,840,096.33	174,671,276.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安货币市场基金

本报告期:2017年1月1日 至 2017年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	7,121,700,265.59	-	7,121,700,265.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,840,096.33	48,840,096.33
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)	-5,811,015,513.24	-	-5,811,015,513.24
其中:1.基金申购款	9,080,976,236.64	-	9,080,976,236.64
2.基金赎回款	-14,891,991,749.88	-	-14,891,991,749.88
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)	-	-48,840,096.33	-48,840,096.33
五、期末所有者权益(基金净值)	1,310,684,752.35	-	1,310,684,752.35

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	14,682,725,349.85	-	14,682,725,349.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	174,671,276.01	174,671,276.01
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)	-6,621,175,914.55	-	-6,621,175,914.55
其中:1.基金申购款	30,984,819,269.38	-	30,984,819,269.38
2.基金赎回款	-37,605,995,183.93	-	-37,605,995,183.93
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)	-	-174,671,276.01	-174,671,276.01
五、期末所有者权益(基金净值)	8,061,549,435.30	-	8,061,549,435.30

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:

_____奥成文 _____薛有为 _____薛有为

基金管理人负责人 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

诺安货币市场基金(简称"本基金"),经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")证监基金字[2004]162号文《关于同意诺安货币市场基金募集的批复》核准,于2004年11月8日至2004年11月30日向社会进行公开募集,经利安达会计师事务所验资,共募集资金人民币1,573,321,100.00元,折合1,573,321,100.00份基金份额。有效认购金额产生的利息为人民币489,376.35元,其中在基金募集期产生的利息为人民币276,940.62元,折合276,940.62份基金份额,其余利息为人民币212,435.73元于基金合同生效后归入本基金。基金合同生效日为2004年12月6日,合同生效日基金份额为1,573,598,040.62份基金单位。

根据《关于诺安货币市场基金实施基金份额分级并修订基金合同、招募说明书和托管协议的公告》,自2012年2月21日起,本基金将基金份额分为A级和B级,不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。本基金两级基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净值收益和7日年化收益率。

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诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。《诺安货币市场基金基金合同》、《诺安货币市场基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于2017年8月25日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称"企业会计准则")和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制。同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深证证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

①以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

②证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税。

③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。

④自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下简称"营改增")试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券收入免征增值税。自2018年1月1日起,资产管理产品管理人运营资产管理产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资产管理产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

⑤基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

⑥对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股权登记日为自2013年1月1日起至2016年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2016年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

⑦基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

⑧对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。

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 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,838,699.97	21,582,727.31
其中:支付销售机构的客户维护费	1,041,986.40	1,594,080.43

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计算,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为前一日的基金资产净值

基金管理人的基金管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,466,272.75	6,540,220.30

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计算,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为前一日的基金资产净值

基金管理人的基金托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取,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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安货币A	诺安货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	39,663.78	127,850.94	167,514.72
中国工商银行股份有限公司(托管人)	104,095.66	692.75	104,788.41
合计	143,759.44	128,543.69	272,303.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	诺安货币A	诺安货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	60,926.09	630,249.60	691,175.69
中国工商银行股份有限公司(托管人)	73,999.24	447.54	74,446.78
合计	134,925.33	630,697.14	765,622.47

注:本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,A级基金份额销售服务费年费率为0.25%,B级基金份额销售服务费年费率为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为每日应计提的基金销售服务费

E为