万家货币市场证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
送出日期：2013年8月28日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年8月26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2013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	万家货币
基金主代码	519508
交易代码	519508
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月24日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,747,044,182.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力保本金稳妥和基金资产高流动性的基础上，为投资者提供资金的流动性储备，并追求高于业绩比较基准的稳定收益
投资策略	通过短期利率预期策略、类属资产配置策略和无风险套利操作策略构建投资组合，谋求在满足流动性要求、控制风险的前提下，实现基金收益的最大化
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险、高流动性的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金

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		万家基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	郑鹏
	联系电话	021-38619810	010-85238667
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhjjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话		95538转6，4008880800	95577
传真		021-38619888	010-85238680

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	http://www.wjasset.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼基金管理人办公场所

§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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	201,460,388.99
本期利润	201,460,388.99
本期净值收益率	1.8498%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2013年6月30日)**
期末基金资产净值	4,747,044,182.07
期末基金份额净值	1.0000

注：1、本基金收益分配按月结转份额。

2、本基金无持有人申购、赎回的交易费用。

3、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。

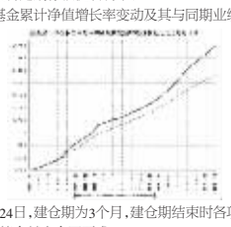
3.2 基金净值表现

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	0.2857%	0.0033%	0.2466%	0.0000%	0.0391%	0.0033%
过去三个月	0.9242%	0.0040%	0.7479%	0.0000%	0.1763%	0.0040%
过去六个月	1.8498%	0.0040%	1.4877%	0.0000%	0.3621%	0.0040%
过去一年	3.6733%	0.0050%	3.0034%	0.0001%	0.6699%	0.0049%
过去三年	12.0777%	0.0070%	9.2014%	0.0011%	2.8763%	0.0059%
自基金合同生效起至今	26.3446%	0.0094%	20.2993%	0.0018%	6.0453%	0.0076%

注：业绩比较基准为一年期银行定期存款税后利率。

3.2.2 自基金合同生效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2006年5月24日，建仓期为3个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

§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

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字［2002］44号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司，住所地及办公地点均为上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼，注册资本1亿元人民币。目前管理十五只基金，分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家公用事业行业股票型证券投资基金、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选股票型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数型证券投资基金、万家添利分级债券型证券投资基金、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、万家岁得利定期开放债券型发起式证券投资基金和万家强化收益定期开放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		
唐俊杰	本基金基金经理、万家稳健增利基金基金经理、万家信用恒利债券基金基金经理	2011年11月5日	-	4年	硕士学位，曾任金元证券股份有限公司投资经理。2011年9月加入万家基金管理有限公司。
孙驰	本基金基金经理、万家增强收益基金基金经理、万家14天理财债券基金基金经理、万家强化收益定期开放债券型基金基金经理、固定收益部副总监	2011年3月19日	-	5年	硕士学位，曾任中海信托股份有限公司投资经理。2010年4月加入万家基金管理有限公司，曾担任固定收益研究员、基金经理助理。

注：1、任职日期以公告为准。

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

本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和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，为基金持有人谋取最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

报告期内6月份，因连续大额赎回，本基金有五个交易日出现过正回购比例超过20%的情况。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《公平交易管理办法》和《异常交易监控及报告管理办法》等规章制度，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司制订了明确的投资授权制度，并建立了统一的投资管理平台，确保不同投资组合获得公平的投资决策机会。实行集中交易制度，对于交易所公开竞价交易，执行交易系统中的公平交易程序；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，按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。为保证公平交易原则的实现，通过制度规范、流程审批、系统风控参数设置等进行事前控制，通过对投资交易系统的实时监控进行事中控制，通过对异常交易的监控和分析实现事后控制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况：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超过该证券当日成交量的5%。

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

本基金在上半年，年初由于准确判断经济依然表现疲软，资金面维持宽松状态，及时增持部分短期融资券，获得了较好的投资收益；随着收益率的不断下行，资金面开始逐步偏紧，本基金及时降低了债券仓位，保持了较高的流动性资产配置，较好地规避了债券的下跌风险；此外，合理安排了资金的到期分配，很好应对了基金规模的缩减。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为1.8498%，业绩比较基准收益率为1.4877%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年经济增长依然会较为温和，去杠杆及调结构将会导致经济增速在短期内有所放缓，但是有利于形成新的增长动力，带来更加健康及可持续的发展；cpi水平将会出现小幅上升，但是基本仍维持在中等偏下水平；预计央行将会继续实行稳健的货币政策，而美国量化宽松政策的逐步退出，资金面存在一定的不确定性以及较大的波动性，预计整体将会出现适度偏紧的状态。经济状况的不佳同样会导致部分信用债存在资质恶化的风险。整体而言，下半年债券市场大概率上将会呈现出窄幅震荡的特征；如果随着经济下行压力的显现，货币政策出现调整，债券市场将会迎来较好的结构性机会。

基于以上的判断，本基金在下半年将会保持短期融资券适中配置比例；进一步加大协议存款的投放比例，合理安排好流动性，以求获得较为稳定的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金每日计算分配收益，按月集中支付。本报告期内本基金应分配利润201,460,388.99元，本报告期内本基金已分配利润201,460,388.99元。

§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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

自6月7日起，基金连续发生大额赎回，多日连续的大额赎回导致基金承受很大流动性压力，对基金资产的运用也产生巨大影响。为应对赎回压力，本基金进行正回购操作，导致6月17日起正回购比例超过20%。托管人根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，对管理人进行了电话及书面提示。

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

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2013年半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：万家货币市场证券投资基金

报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产：		
银行存款	805,776,014.12	2,127,777,359.36
结算备付金	6,590,909.09	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,643,750,989.85	6,027,136,453.53
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,643,750,989.85	6,027,136,453.53
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	99,997,390.00	1,546,544,359.81
应收证券清算款	-	84,235,178.08
应收利息	62,775,003.18	82,843,514.10
应收股利	-	-
应收申购款	180,473,922.87	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,799,364,229.11	9,868,536,864.88
负债和所有者权益	**本期末 2013年6月30日**	**上年度末 2012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	39,999,720.00	645,588,311.62
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	666,046.65	104,220.62
应付管理人报酬	2,031,276.59	3,571,478.32
应付托管费	615,538.31	1,082,266.17
应付销售服务费	1,538,845.84	2,705,665.40
应付交易费用	84,351.77	98,421.13
应交税费	47,400.00	47,400.00
应付利息	57,769.93	422,389.27
应付利润	7,194,792.18	16,055,998.54
递延所得税负债	-	-
其他负债	84,305.77	170,001.43
负债合计	52,320,047.04	669,846,152.50
所有者权益：		
实收基金	4,747,044,182.07	9,198,690,712.38
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,747,044,182.07	9,198,690,712.38
负债和所有者权益总计	4,799,364,229.11	9,868,536,864.88

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额4,747,044,182.07份。

6.2 利润表

会计主体：万家货币市场证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	248,430,202.60	239,373,112.83
1.利息收入	223,840,052.18	196,861,735.04
其中：存款利息收入	89,823,921.22	30,508,362.56
债券利息收入	99,112,044.13	91,306,818.82
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	34,904,086.83	75,046,553.66
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	24,590,150.42	42,511,377.79
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,590,150.42	42,511,377.79
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)	-	-
减：二、费用	46,969,813.61	32,948,375.19
1.管理人报酬	18,158,261.71	13,693,982.86
2.托管费	5,502,503.48	4,149,691.84
3.销售服务费	13,756,258.84	10,374,229.49
4.交易费用	-	-
5.利息支出	9,448,842.00	4,640,134.76
其中：卖出回购金融资产支出	9,448,842.00	4,640,134.76
6.其他费用	103,947.58	90,336.24
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	201,460,388.99	206,424,737.64
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	201,460,388.99	206,424,737.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：万家货币市场证券投资基金

本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	9,198,690,712.38	-	9,198,690,712.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	201,460,388.99	201,460,388.99
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）	-4,451,646,530.31	-	-4,451,646,530.31
其中：1.基金申购款	39,790,987,613.25	-	39,790,987,613.25
2.基金赎回款	-44,242,634,143.56	-	-44,242,634,143.56
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）	-	-201,460,388.99	-201,460,388.99
五、期末所有者权益(基金净值)	4,747,044,182.07	-	4,747,044,182.07
项目	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	6,089,966,351.05	-	6,089,966,351.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	206,424,737.64	206,424,737.64
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）	1,961,410,426.07	-	1,961,410,426.07
其中：1.基金申购款	35,790,882,565.53	-	35,790,882,565.53
2.基金赎回款	-33,829,472,139.46	-	-33,829,472,139.46
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）	-	-206,424,737.64	-206,424,737.64
五、期末所有者权益(基金净值)	8,051,376,777.12	-	8,051,376,777.12

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：

_____毕玉国_____　　_____李杰_____　　_____陈广益_____

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

万家货币市场证券投资基金（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］69号文《关于同意万家货币市场证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人万家基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2006年5月24日正式生效，首次设立募集规模为2,437,395,340.44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万家基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

本基金采取主动式投资管理策略，主要投资于现金、通知存款、1年以内（含1年）的银行定期存款及大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、期限在1年以内（含1年）的债券回购、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据，以及中国证监会、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。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在力保本金稳妥和基金资产高流动性的基础上，为投资者提供资金的流动性储备，并追求高于业绩比较基准的稳定收益。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款税后利率。

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，也参考了中国证券投资基金业协会制定的《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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至6月30日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

本半年度报告所采用的会计政策、会计估计与上年度报告相一致。

6.4.5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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字［2008］132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定：自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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

1、本报告期内，新疆国际实业股份有限公司受让上海久事公司和深圳市中航投资管理有限公司持有的本基金管理人万家基金管理有限公司各20%的股权，该两起股权转让事项于2013年2月经中国证券监督管理委员会核准，并已办理完毕工商变更登记手续。本次股权转让后，基金管理人的股权结构变更为：齐鲁证券有限公司持股49%，新疆国际实业股份有限公司持股40%，山东省国有资产投资控股有限公司持股11%。

2、报告期内，基金管理人子公司万家共赢资产管理有限公司于2013年2 月正式成立，基金管理人持有其51%股份。

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
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、基金销售机构
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人主要股东、基金代销机构

注：以下关联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

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交易。

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,158,261.71	13,693,982.86
其中：支付销售机构的客户维护费	4,079,056.22	4,368,783.67

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为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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2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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,502,503.48	4,149,691.84

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为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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2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

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	5,881,858.57
华夏银行股份有限公司	370,391.41
合计	6,252,249.98
获得销售服务费各关联方名称	**上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日**
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	2,542,092.82
华夏银行股份有限公司	733,825.44
合计	3,275,918.26

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。本基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计算。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构，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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012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
齐鲁证券有限公司	-	-	500,000,000.00	5.44%

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
华夏银行股份有限公司	5,776,014.12	371,880.05	33,489,034.37	275,019.75

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2013年1月1日至6月30日获得的利息为人民币28,690.60元（2012年1月1日至6月30日为人民币15,738.79元），2013年6月30日结算备付金余额为人民币6,590,909.09元（2012年6月30日余额为人民币5,909,090.91元）。

6.4.8.6 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不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013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39,999,720.00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
090205	09国开05	2013年7月1日	100.87	200,000	20,173,133.04
041365002	13灵山CP001	2013年7月8日	100.00	200,000	20,000,481.96
合计				400,000	40,173,615.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无交易所市场正回购余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	3,643,750,989.85	75.92
	其中：债券	3,643,750,989.85	75.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	99,997,390.00	2.08
	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	812,366,923.21	16.93
4	其他各项资产	243,248,926.05	5.07
5	合计	4,799,364,229.11	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.97	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	**项目**	**金额**	**占基金资产净值的比例(%)**
2	报告期末债券回购融资余额	39,999,720.00	0.84
	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的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2013年6月17日	22.56	连续大额赎回导致	到2013年6月24日调整完毕
2	2013年6月18日	28.11	连续大额赎回导致	到2013年6月24日调整完毕
3	2013年6月19日	27.36	连续大额赎回导致	到2013年6月24日调整完毕
4	2013年6月20日	28.13	连续大额赎回导致	到2013年6月24日调整完毕
5	2013年6月21日	27.29	连续大额赎回导致	到2013年6月24日调整完毕

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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	141
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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	13.83	0.84
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	12.31	-
2	30天(含)—60天	8.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.44	-
3	60天(含)—90天	36.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.29	-
4	90天(含)—180天	24.12	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	12.85	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		95.97	0.84

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	1,708,549,439.73	35.99
	其中：政策性金融债	1,708,549,439.73	35.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,935,201,550.12	40.77
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	3,643,750,989.85	76.76
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,188,581,354.90	25.04

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	090213	09国开13	4,400,000	445,570,128.77	9.39
2	090205	09国开05	3,900,000	393,376,094.37	8.29
3	130212	13国开12	2,100,000	210,984,118.50	4.44
4	120318	12进出18	2,000,000	200,002,954.99	4.21
5	110221	11国开21	1,400,000	138,651,013.26	2.92
6	041260068	12陕高速CP001	1,350,000	135,036,574.98	2.84
7	130210	13国开10	1,100,000	110,023,237.49	2.32
8	120238	12国开38	1,100,000	109,945,124.66	2.32
9	041264027	12郑煤CP001	1,000,000	100,016,167.92	2.11
10	041359024	13安钢集CP001	800,000	80,068,039.19	1.69

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	14
报告期内偏离度的最高值	0.2933%
报告期内偏离度的最低值	-0.1657%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1895%

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

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率每