

(上接B054版)		
金额单位:人民币元		
序号	项目	金额 占基金资产的比例 (%)
1 固定收益投资	9,881,596,772.38	29.17
其中:债券	9,881,596,772.38	29.17
货币市场证券	-	-
2 买入返售金融资产	1,200,002,400.00	354
其中:质押式回购的买入返售金融资产	-	-
3 衍生工具及权证	22,569,570,630.05	66.61
4 其他各项资产	229,906,628.14	0.68
5 合计	33,881,076,631.37	100.00

## 5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元		
序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
1 报告期内信用购货融资余额	2,033	
其中:买断式回购融资		
序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
2 报告期末信用购货融资余额	-	
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余额占资产净值比例的简单平均值。

报告期债券正回购的资金余额超过基金资产净值的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%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

## 5.3.1 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		117
报告期初投资组合平均剩余期限最高值		120
报告期初投资组合平均剩余期限最低值		50

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

在本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

## 5.3.2 报告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的比重(%)	
		长期限负债占基金资产的比重(%)	短期限负债占基金资产的比重(%)
1 30天以内	19.98	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
2 30天(含)-60天	15.36	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.12	-	-
3 60(不含)-90天	13.60	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
4 90(不含)-180天	27.66	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
5 180天(含)-397天(不含)	22.91	-	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	-
6 合计	99.38	-	-

## 5.4 报告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 行业票据	-	-
3 金融债券	2,168,452,730.97	6.40
其中:政策性金融债	2,168,452,730.97	6.40
4 企业债券	-	-
5 企业短期融资券	4,270,649,737.22	12.61
6 中期票据	-	-
7 同业存单	3,442,494,30450	10.17
8 其他	-	-
9 合计	9,881,596,772.38	29.18
10 剩余期限超过397天的浮动利率债	40,496,983.95	0.12

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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 摊余成本 占基金资产净值比例 (%)
1	150413	15农发13 10,000,000 999,786,640.82 2.95
2	11151031	15国开CD315 10,000,000 983,435,760.06 2.90
3	11151029	15平银CD230 10,000,000 983,435,760.06 2.90
4	11151021	15兴业CD313 10,000,000 983,409,614.65 2.90
5	150411	15农发11 5,050,000 506,119,180.00 1.49
6	11151207	15京银行CD071 5,000,000 492,213,189.82 1.46
7	01159917	15陕农信CP001 2,500,000 250,402,794.53 0.74
8	01159969	15陕农信CP004 2,400,000 229,766,027.88 0.71
9	01151610	15万科SCP004 2,000,000 199,988,982.27 0.59
10	01151610	15陕农信CP002 2,000,000 199,944,671.93 0.59

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目			偏离幅度%
报告期平均偏离的绝对值(0.2%以内-0.5%之间的次数	0次		
报告期平均偏离的最高值	0.11%		
报告期平均偏离的最低值	0.06%		
报告期每个工作日偏离的绝对值的简单平均数	0.07%		

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

## 5.8 投资组合报告附注

## 5.8.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场的特性,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按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

5.8.2 报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,未发生对该类浮动利率债券的摊余成本超出现当期基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

## 5.8.4 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	201,080,296.63	
4 应收申购款	28,758,225.21	
5 其他应收款	68,250.00	
6 待摊费用	-	-
7 其他	-	-
8 合计	229,906,828.14	

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.8.5.1 本报告期内没有需特别说明的证券投资决策程序。

5.8.5.2 由于买入人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。”

## 十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

华夏货币A:

阶段	份额净值 收益率①	净收益 率标准差②	业绩比较 基准收益率 标准差③	业绩比较 基准收益率 标准差④	①-③	②-④
					①-③	②-④
2005年4月20日至 2005年12月31日	14.15%	0.0033%	1.2000%	0.0000%	13.88%	0.0033%
2006年1月1日至 2006年12月31日	19.39%	0.0020%	1.9069%	0.0033%	19.07%	0.0017%
2007年1月1日至 2007年12月31日	3.45%	0.0018%	2.8227%	0.0019%	0.63%	0.0062%
2008年1月1日至 2008年12月31日	4.67%	0.015%	3.2429%	0.0012%	0.84%	0.0145%
2009年1月1日至 2009年12月31日	2.15%	0.015%	2.2655%	0.0000%	-0.11%	0.0151%
2010年1月1日至 2010年12月31日	2.1344%	0.0079%	2.3041%	0.0003%	-0.16%	0.0076%
2011年1月1日至 2011年12月31日	3.87%	0.0071%	3.2801%	0.0007%	0.59%	0.0