汇添富货币市场基金 2008年年度报告摘要

§1 重要提示及目录

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2009年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2008年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	添富货币	
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	
报告期末基金份额总额	10,704,998,541.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	添富货币A级	添富货币B级
下属两级基金的交易代码	519518	519517
报告期末下属两级基金的份额总额	842,604,116.22份	9,862,394,425.07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	银行一年期定期存款的税后利率；(1－利息税率)×银行一年期定期储蓄存款利率。
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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.99fund.com
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2008年		2007年		2006年
	A级	B级	A级(2007年1月1日至2007年12月31日)	B级(2007年5月22日至2007年12月31日)	A级(2006年3月23日至2006年12月31日)
本期已实现收益	12,248,554.74	92,106,768.85	15,530,742.37	24,418,022.44	17,959,474.95
本期利润	12,248,554.74	92,106,768.85	15,530,742.37	24,418,022.44	17,959,474.95
本期净值收益率	3.27%	3.52%	3.68%	2.97%	1.44%
3.1.2 期末数据和指标	2008年		2007年		2006年
	A级	B级	A级(2007年1月1日至2007年12月31日)	B级(2007年5月22日至2007年12月31日)	A级(2006-3-23至2006-12-31)
期末基金资产净值	842,604,116.22	9,862,394,425.07	472,044,121.52	1,027,397,901.70	720,606,021.46
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	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。

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 基金净值表现

3.2.1 汇添富货币市场A级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

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
过去三个月	1.2873%	0.0251%	0.8178%	0.0018%	0.4695%	0.0233%
过去六个月	1.9838%	0.0180%	1.8064%	0.0016%	0.1774%	0.0164%
过去一年	3.2765%	0.0131%	3.7621%	0.0012%	-0.4916%	0.0119%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效起至今	8.6159%	0.0105%	8.2309%	0.0024%	0.3850%	0.0081%

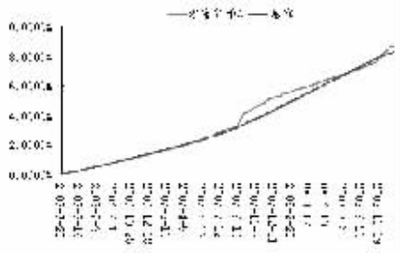
注：本基金的《基金合同》生效之日为2006年3月23日，至本报告期末未满三年。

汇添富货币市场B级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

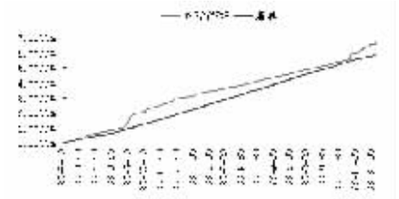
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3477%	0.0251%	0.8178%	0.0018%	0.5299%	0.0233%
过去六个月	2.1058%	0.0180%	1.8064%	0.0016%	0.2994%	0.0164%
过去一年	3.5181%	0.0131%	3.7621%	0.0012%	-0.2440%	0.0119%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效起至今	6.5939%	0.0129%	5.8021%	0.0015%	0.7918%	0.0114%

注：汇添富货币市场B级基金的基金分级日为2007年5月22日，至本报告期未未满三年。

3.2.2 自基金合同生效以来汇添富货币市场A级基金份额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

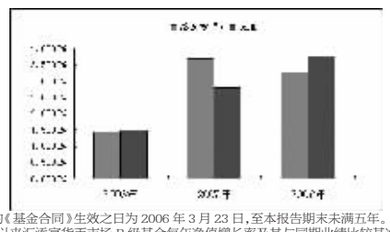


自基金分级以来汇添富货币市场B级基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



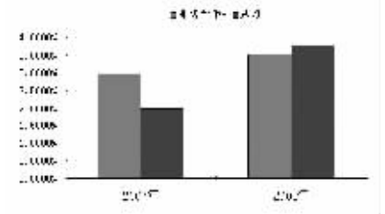
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2006年3月23日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来汇添富货币市场A级基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的《基金合同》生效之日为2006年3月23日，至本报告期末未满五年。

自基金分级以来汇添富货币市场B级基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：汇添富货币市场B级基金的基金分级日为2007年5月22日，至本报告期未未满五年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	再投资形式发放总额	备注
2008年	104,355,323.59	-
2007年	39,948,764.81	-
2006年	17,959,474.95	-
合计	162,263,563.35	-

§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。截止到2008年12月31日，公司管理证券投资基金规模达到472亿元，基金份额持有人户数超过193万，资产管理规模在行业内名列前茅。公司管理6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。

2008年，汇添富基金凭借优异的业绩和稳健的经营，荣获多家机构评选的多个奖项：

奖项	颁奖单位	获奖日期
汇添富基金管理有限公司荣获2007年度最具成长性基金公司——第五届财经风云榜	和讯网	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具价值基金公司(吉林地区)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具竞争力基金公司(陕西地区)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具价值基金公司(全国)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获最具竞争力基金公司(重庆地区)——2007年度理财总评榜	中国主流媒体理财联盟	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年度"金牛基金管理公司"称号——第五届中国基金业金牛奖评选	(中国证券报)	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金管理公司综合实力大奖——"中国赢基金奖"综合奖	(21世纪经济报道)	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金管理公司最佳公司治理奖——"中国赢基金奖"综合奖	(21世纪经济报道)	2008年1月
汇添富400客户服务中心荣获用户满意电子金融服务品牌——中国电子金融发展年会	中国电子商务协会	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金公司投资回报优秀奖——中国基金十年高峰论坛	网易财经	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国最受尊敬基金公司——中国基金十年高峰论坛	网易财经	2008年1月
添富国荣获用户满意电子金融品牌——中国电子金融发展年会	中国电子商务协会	2008年1月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年度"金牛基金管理公司"称号——第五届中国基金业金牛奖评选	(中国证券报)	2008年1月
汇添富基金管理有限公司获得"2007年十大最受欢迎的基金公司"	(新民晚报)、东方财富网	2008年2月
汇添富基金管理有限公司获得"十大最受信赖基金公司"——2008年度(新闻晨报)十大基金评选	新闻晨报	2008年9月
汇添富基金管理有限公司获得"2008中国最受尊敬基金公司"	21世纪报系(理财周报)	2008年9月
汇添富基金管理有限公司荣获2007年中国基金管理公司最佳投资团队奖——"中国赢基金奖"综合奖	(21世纪经济报道)	2008年10月
汇添富基金管理有限公司荣获2008第一财经金融价值榜(CFV)——年度社会责任奖	(第一财经日报)	2008年11月
汇添富基金获2008年"最有影响力基金投资者教育奖"	搜狐理财	2008年12月

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

2008年12月31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：2009年3月26日

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。	2005年11月8日	-	14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，2005年11月8日至今任汇添富货币市场基金的基金经理，2007年11月3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。

注：1、基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、基金经理的证券从业年限按其从事证券研究分析、投资管理等业务的年限计算。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。

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

回顾过去的2008年，中国宏观经济呈现出前高后低的走势，从上半年的过热局面迅速转向下半年的硬着陆。相应地，央行在上下半年采取了方向截然相反的短期连续大幅调控的货币政策工具来平抑经济波动。上半年宏观经济延续2007年的高速发展态势，从各项经济数据到实体经济各个产业都暴露出严重过热的迹象。为了避免可能产生的恶性通货膨胀，央行采取了几乎一月一调准备金率的方式，把存款准备金从年初的14.50%上调至6月份17.5%的历史最高水平。奥运会过后，宏观经济出现迅速降温态势。经过2个月的观察，央行从9月份开始，按照"一保一控"的方针进行调控，实施宽松的货币政策，4次下调存款准备金率和5次下调基准利率。

在货币政策前紧后松的影响下，货币市场波动加剧，短期资金拆借利率全年总计出现了6次较大幅度的波动，一年期央行票据收益率出现了1.0%－4.20%之间的宽幅震荡。

报告期内，本基金对全年经济形势进行了较为准确的判断，在年初制定了"在承担适当的投资风险的基础上积极投资"的投资基调，根据市场变化，及时调整了投资策略：一方面增加了高流动性短期债券投资，另一方面通过完善的信用评估体系增加了高收益率企业短期融资券投资。具体而言，本基金上半年以短期金融债券和央行票据作为主要投资标的，投资组合的剩余期限紧随利率的波动积极调整；下半年适当调高了组合中短融的投资比例，获取了较好的收益。虽然运作期间大量申购资金增加了投资难度，本基金尽可能维护了投资组合的稳定性，有效降低了市场波动对基金收益的冲击。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一投资年度，本基金认为我国宏观经济将在世界经济整体衰退的背景下实施积极的财政政策和宽松的货币政策。美国次贷危机引发全球性的总需求下降，中国的外需受到冲击已成定局。中国政府正大力推行扩张性财政政策和宽松的货币政策，并出台各种振兴经济的产业政策，以期以政府力量平抑经济波动，在内需的投资和消费方面取得新的经济增长支点。

基于上述展望，本基金相信下一投资年度货币市场非常可能显现如下三个特征：第一，银行体系的流动性将较为宽裕；为了顺利实施扩张性的宏观刺激政策，预计央行的公开市场操作将是以释放货币为主、阶段性微调为辅，银行超额准备金率也有下调空间，全年货币市场将保持充裕的流动性。第二，央行的降息空间不大；央行仍然担心远期通胀风险，基准利率再度下调的可能性较小。第三，IPO等短期因素影响货币市场的作用有限。鉴于上述货币市场特征的预期，本基金在下一投资年度将通过制定合理的投资策略，在完善信用评估体系的基础上，设计合适的投资组合期限，选择信用风险较低的企业债券进行配置，一如既往地构建兼备较高流动性和收益性的投资组合，给投资者创造满意的收益。

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、产品与金融工程部、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

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2,298,952.66元，2008年1月01日至2008年12月31日期间累计分配收益104,355,323.59元，其中人民币66,196,592.51元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币18,828,562.25元因基金赎回而支付给投资者，其余人民币21,629,121.49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

上海浦东发展银行股份有限公司依据《汇添富货币市场基金基金合同》与《汇添富货币市场基金托管协议》，托管汇添富货币市场基金。2008年，在对汇添富货币市场基金的托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产，对汇添富货币市场基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生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

2008年，上海浦东发展银行股份有限公司依照《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、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，对基金净值计算、利润分配、基金费用开支等进行了认真的复核，监督过程中，本托管人发现，在报告期内本基金偏离度的绝对值在0.25（含）－0.5%间的次数为52次，偏离度超过为0.5%的次数为1次，管理人已按照相关基金信息披露法规进行了适当披露，除此之外，未发现基金管理人损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

经上海浦东发展银行股份有限公司资产托管部复核，由汇添富基金管理有限公司编制的本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所审计，注册会计师徐艳、方侃签字出具了安永华明（2009）审字第60466941_B02号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富货币市场基金

报告截止日：2008年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,507,716,724.66	60,047,735.38
结算备付金		10,043,000.00	18,354,020.68
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	5,759,739,851.46	426,757,492.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,759,739,851.46	426,757,492.60
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	1,028,902,598.25
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	39,115,695.77	1,876,022.80
应收股利		-	-
应收申购款		798,178,635.81	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		12,115,043,907.70	1,536,187,869.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007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		1,384,437,537.84	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		162,777.50	33,164,704.38
应付管理人报酬		1,957,150.26	299,571.29
应付托管费		593,075.82	90,779.16
应付销售服务费		194,885.15	89,380.37
应付交易费用	7.4.7.7	77,534.58	-7,706.37
应交税费		348,000.00	348,000.00
应付利息		68,334.86	-
应付利润		21,629,121.49	2,298,952.66
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	576,948.91	462,165.00
负债合计		1,410,045,366.41	36,745,846.49
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	10,704,998,541.29	1,499,442,023.22
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		10,704,998,541.29	1,499,442,023.22
负债和所有者权益总计		12,115,043,907.70	1,536,187,869.71

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日2008年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额10,704,998,541.29份，其中，A级份额842,604,116.22份，B级份额9,862,394,425.07份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富货币市场基金

本报告期：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入		117,444,113.41	45,344,188.25
1.利息收入		73,439,497.50	48,291,761.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,109,776.75	3,071,601.88
债券利息收入		62,547,591.24	12,954,131.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,782,129.51	32,266,027.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		43,957,337.57	-2,947,573.24
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	43,957,337.57	-2,947,573.24
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)	7.4.7.13	47,278.34	-
二、费用(以"-"号填列)		-13,088,789.82	-5,395,423.44
1.管理人报酬		-7,893,379.53	-2,695,011.04
2.托管费		-2,391,933.19	-816,669.91
3.销售服务费		-1,054,852.22	-1,073,952.06
4.交易费用		-	-
5.利息支出		-1,256,338.01	-326,490.82
其中：卖出回购金融资产支出		-1,256,338.01	-326,490.82
6.其他费用	7.4.7.14	-492,286.87	-483,299.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		104,355,323.59	39,948,764.81
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		104,355,323.59	39,948,764.81

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 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：2008年1月1日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31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)	1,499,442,023.22	-	1,499,442,023.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	104,355,323.59	104,355,323.59
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）	9,205,556,518.07	-	9,205,556,518.07
其中：1.基金申购款	23,910,050,877.55	-	23,910,050,877.55
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-14,704,494,359.48	-	-14,704,494,359.48
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)	-	-104,355,323.59	-104,355,323.59
五、期末所有者权益(基金净值)	10,704,998,541.29	-	10,704,998,541.29
项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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)	720,606,021.46	-	720,606,021.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,948,764.81	39,948,764.81
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）	778,836,001.76	-	778,836,001.76
其中：1.基金申购款	7,923,394,965.85	-	7,923,394,965.85
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-7,144,558,964.09	-	-7,144,558,964.09
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)	-	-39,948,764.81	-39,948,764.81
五、期末所有者权益(基金净值)	1,499,442,023.22	-	1,499,442,023.22

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.4 报表附注

7.4.1 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相一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未有会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未有会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金本报告期内不存在重大会计差错。

7.4.3 关联方关系

7.4.3.1 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	基金发起人、基金管理人、基金直销机构
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	基金管理人股东、基金代销机构
东航金戎投股有限责任公司	基金管理人股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人股东

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	年成交金额	占全年交易金额的比例	年成交金额	占全年交易金额的比例
东方证券股份有限公司	6,557,700,000.00	100.00%	11,837,246,736.51	100.00%

7.4.4.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东方证券股份有限公司	-57,386.00	100.00%	-28,720.50	100.00%

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缴付本基金。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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	7,893,379.53	2,695,011.04
其中：当期已支付	5,936,229.27	2,395,439.75
期末未支付	1,957,150.26	299,571.29

注：(1) 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。

(2) 上述表格中"当期已支付"不包含当期已支付的上期应付管理费。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	2,391,933.19	816,669.91
其中：当期已支付	1,798,857.37	725,890.75
期末未支付	593,075.82	90,779.16

注：(1) 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。

(2) 上述表格中"当期已支付"不包含当期已支付的上期应付托管费。

7.4.4.2.3 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 2008年1月1日至2008年12月31日 当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计	
			A级	B级
汇添富基金管理有限公司	158,441.77	160,195.99	132,256.87	186,380.89
上海浦东发展银行股份有限公司	184,669.85	28,060.42	203,788.23	8,942.04
东方证券股份有限公司	-	32,114.27	31,668.64	445.63
合计	343,111.62	220,370.68	367,713.74	195,768.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日 当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计	
			A级	B级
汇添富基金管理有限公司	335,445.83	54,103.34	377,917.60	11,631.57
上海浦东发展银行股份有限公司	264,685.73	206,713.25	447,247.52	24,151.46
东方证券股份有限公司	-	30,340.99	30,110.84	230.15
合计	600,131.56	291,157.58	855,275.96	36,013.18

注：(1) 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。

(2) 上述表格中"当期已支付"不包含当期已支付的上期应付销售服务费。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金2008年度及2007年度未与关联方进行银行间债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人2008年度及2007年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于2008年年末及2007年年末均未投资本基金。

7.4.4.5 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 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	5,507,716,724.66	4,453,572.59	60,047,735.38	2,353,731.89

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2008年度及2007年度在承销期内未有参与关联方承销证券的情况。

7.4.5 期末（2008年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31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1,384,437,537.84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
0801016	08央票16	2009.1.05	99.58	4,000,000	398,302,628.24
0801104	08央票104	2009.1.05	98.96	7,400,000	732,309,181.25
0801034	08央票34	2009.1.05	99.12	400,000	39,649,