

## 益民货币市场基金

## [2014] 第二季度报告

基金管理人:益民基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2014年7月21日

§ 1 声明及提示

本基金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。

本基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本基金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财产，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。基金管理人提醒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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	益民货币
交易代码	560001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月17日
报告期末基金份额总额	159,114,585.00
投资目标	在力求本金安全的前提下，力争取得超过业绩比较基准的收益。
投资策略	深入分析国家政策、宏观经济形势和资金利差情况，寻求资金的高收益投资机会。本基金将根据宏观经济形势、资金利差情况，调整货币市场基金资产配置和组合的期限，结合市场情况适时进行短期投资，择机买卖货币市场基金。
业绩比较基准	六个月定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本货币市场基金具有低风险、流动性强的货币品种，在一定程度上，其风险与收益低于一般债券基金和股票型基金。
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2014年4月1日-2014年6月30日)

1.本期已实现收益 1,226,596.33

2.本期利润 1,226,596.33

3.期末基金资产净值 159,114,585.00

注:本基金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，本期利润指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 本基金报告期内份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 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

注:本基金自2006年7月17日合同生效之日起三个月内为建仓期，建仓期结束时投资组合比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
李鹤波	益民货币市场基金基金经理	2011年8月31日	-	清华大学硕士。曾任中行资产投资管理有限公司基金经理。2011年8月加入益民基金管理有限公司，任益民货币市场基金经理，经理多只债券型基金和货币基金，任益民货币基金经理。自2011年8月起任益民货币基金经理，同时担任益民货币基金经理。
李鹤波	益民货币市场基金基金经理	2013年9月13日	-	清华大学硕士，现任国家开发银行信贷经理，兼任中国证券投资基金业协会研究部研究员。2011年8月加入益民基金管理有限公司，任益民货币基金经理，基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性的说明

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.3 公平交易制度的说明

本基金交易行为符合公平交易制度的规定。

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，避免出现不公平交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金管理法》、《证券投资基金管理办法》公平交易制度的规定，制定了《益民基金管理有限公司公平交易管理制度》，并建立了有良好的内部控制和分析评估体系，确保各投资组合在公平交易、公平定价方面不存在明显不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

4.4 报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为。不存在报告期内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%的情形。

## 4.4.1 报告期内本基金的基金策略和业绩表现说明

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.4.2 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 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2014年一季度，本基金认为经济企稳迹象显现，货币政策调控的不确定性加大，流动性较难把握，将密切关注政策变化，密切关注政策对经济的支撑作用，同时调整组合的资产配置和久期分布，力争在风险可控的前提下为投资者创造稳定的、理性的投资回报。

## 4.6 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为。不存在报告期内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%的情形。

## 4.7 管理人对报告期内本基金运作合规性的说明

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.8 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

4.9 报告期内本基金报告的前十名资产支持证券投资明细

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.10 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.11 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.12 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.13 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.14 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.15 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.16 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.17 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.18 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.19 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.20 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.21 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.22 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.23 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.24 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.25 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.26 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.27 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.28 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.29 报告期内本基金的业绩表现

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

本基金在公平交易制度的执行情况，各投资组合经理在公平交易、公平定价方面不存在不公平对待和利益输送的情况。

## 4.30 报告期内本基金的业绩表现

本基金管理人未运用含有投资基金策略。

## 4.31 报告期内本基金的业绩表现

本基金采用剩余法估值法计价，即估值对象以买入成本为例，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在估值时采用的折价或溢价与上一估值日的折价或溢价相同时，按实际利率和上一估值日的折价或溢价计算。

本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、《益民货币市场证券投资基金基金合同》及其相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，基金管理公司符合相关法律法规和基金合同的规定，为基金份额持有人谋取最大利益。

## 4.