诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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:2014年8月26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2014年8月21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2014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	诺安稳固收益一年定期开放债券
基金主代码	000235
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21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	2,492,597,264.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下,力求资产持续稳妥地保值增值,为投资者提供较好的养老资产管理工具。
投资策略	1、封闭期投资策略 在封闭期内,为合理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每次开放期的流动性需求,原则上本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。同时,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。 2、开放期投资安排 在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。在开放期前根据市场情况,进行相应压力测试,制定开放期操作规范流程和应急预案,做好应付极端情况下巨额赎回的准备 。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:固定业绩基准3.0%。该业绩基准适用于本基金第一个封闭期,其他封闭期的业绩基准由管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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		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	陈勇	赵会军
	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

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	63,489,494.06
本期利润	110,936,021.64
加权平均基金份额本期利润	0.0445
本期基金份额净值增长率	4.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0411
期末基金资产净值	2,637,970,727.86
期末基金份额净值	1.058

注:① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

③ 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.67%	0.05%	0.25%	0.01%	0.42%	0.04%
过去三个月	2.42%	0.05%	0.73%	0.01%	1.69%	0.04%
过去六个月	4.34%	0.05%	1.47%	0.01%	2.87%	0.04%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.05%	2.58%	0.01%	3.22%	0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:固定业绩基准3.0%。该业绩基准适用于本基金第一个封闭期,其他封闭期的业绩基准由管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:①本基金的基金合同于2013年8月21日生效,截至2014年6月30日止,本基金成立未满1年。

②本基金的建仓期为2013年8月21日至2014年2月20日, 建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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2014年6月,本基金管理人共管理34只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、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、诺安中小盘精选股票型证券投资基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、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、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、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、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金及诺安理财宝货币市场基金。

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		
谢志华	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、诺安信用债券一年定期开放债券基金经理、诺安稳固收益一年期定期开放债券基金经理、诺安泰鑫一年定期开放债券基金经理、诺安优化收益债券基金经理及诺安永鑫一年定期开放债券基金经理	2013年8月21日	-	8	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型证券投资基金基金经理,2011年3月至2012年8月任招商安瑞进取债券型证券投资基金基金经理。2012年8月加入诺安基金管理有限公司,任投资经理,2013年5月起任诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金及诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年6月起任诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起任诺安稳固收益一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年11月起任诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年12月起任诺安优化收益债券型证券投资基金基金经理,2014年6月起任诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日;

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》的相关规定等。

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,诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资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《诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》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,超过投资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

经过2013年的大幅调整,债券市场在2014上半年走出了一波牛市行情。一季度以短端收益率下行较多的陡峭化下行为主,而二季度则为长端收益率下行的陡峭化下行为主。对经济增速超预期下行的担忧和“定向降准”的出台,坚定了投资者对货币市场持续宽松的预期,为债券市场行情发展提供了良好环境。二季度末,经济数据企稳修复了投资者对经济过于悲观的预期,债券市场短暂调整,收益率窄幅震荡。

投资运作上,诺安稳固的投资以信用债为主,上半年在宽松的融资环境中,加大了组合的杠杆比例、券种配置方面、基于组合的投资周期、短期品种配置较多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.058元。本报告期基金份额净值增长率为4.34%,同期业绩比较基准收益率为1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济短期企稳,货币政策环比大幅放松的可能性降低,在外汇占款减少的情况下,预计央行将继续结合再贷款、PSL和国库现金定存等工具维持合理的基础货币投放,保持市场合理的流动性。展望三季度,政策微刺激的力度和影响值得关注,央行公开市场操作对短端利率的定位、债券供给扩容节奏也是影响债券市场的重要因素。我们将密切关注各方面因素的变化,努力把握投资机会。

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、监察稽核部和风险控制部、固定收益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

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的50%, 若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

§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稳固收益债券基金证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他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,诺安稳固收益债券基金证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安稳固收益债券基金证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安稳固收益债券基金证券投资基金未进行利润分配。

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稳固收益债券基金证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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:诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	7,691,014.49	380,655,580.92
结算备付金	310,351.38	31,941,428.57
存出保证金	-	31,480.17
交易性金融资产	3,493,374,000.00	1,836,837,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,493,374,000.00	1,836,837,000.00
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	-	260,000,000.00
应收证券清算款	-	153,849.27
应收利息	87,791,038.91	18,958,633.67
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,589,166,404.78	2,528,577,972.60
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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	949,268,116.84	-
应付证券清算款	85,784.19	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	-	-
应付托管费	388,913.36	385,690.11
应付销售服务费	1,080,314.90	1,071,361.36
应付交易费用	25,527.35	26,214.91
应交税费	-	-
应付利息	158,581.18	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	188,439.10	60,000.00
负债合计	951,195,676.92	1,543,266.38
所有者权益:		
实收基金	2,492,597,264.38	2,492,597,264.38
未分配利润	145,373,463.48	34,437,441.84
所有者权益合计	2,637,970,727.86	2,527,034,706.22
负债和所有者权益总计	3,589,166,404.78	2,528,577,972.60

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.058元,基金份额总额2,492,597,264.38份;

6.2 利润表

会计主体:诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	125,810,503.00
1.利息收入	76,616,982.95
其中:存款利息收入	2,363,039.08
债券利息收入	70,793,582.09
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	3,460,361.78
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,746,992.47
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,746,992.47
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)	47,446,527.58
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	14,874,481.36
1.管理人报酬	-
2.托管费	2,301,729.30
3.销售服务费	6,393,692.49
4.交易费用	10,845.00
5.利息支出	5,958,986.13
其中:卖出回购金融资产支出	5,958,986.13
6.其他费用	209,228.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	110,936,021.64
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	110,936,021.64

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	2,492,597,264.38	34,437,441.84	2,527,034,706.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	110,936,021.64	110,936,021.64
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,492,597,264.38	145,373,463.48	2,637,970,727.86

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 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
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。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内不存在应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

本基金管理费采用的浮动费率方式如下:

(1)本基金不收取固定管理费,以分档计提方式收取浮动管理费;

(2)本基金的业绩比较基准为:固定业绩基准3.0%,该业绩基准适用于本基金第一个封闭期,其他封闭期的业绩基准由管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布;

(3)封闭运作一年之后,基金管理人将以封闭期基金净值增长率为基础分档收取管理费。在分档模式下,基金管理人将封闭期基金净值增长率由低到高划分为四档并设定不同等级的管理费率。封闭期基金净值增长率越大的档,管理费率越高(具体档数、不同档数封闭期基金净值增长率起止点、不同档数管理费率如下表)。管理费在管理费计提日计提,并将对应四档管理费计提日基金份额净值。同时,管理费的提取将保证高档数的管理费计提日基金份额净值不低于低档数的管理费计提日基金份额净值。

基金管理费分档费率表

设N为封闭期基金净值增长率:

档数	封闭期基金净值增长率(N)	管理费率
1	N≤4.0%	0%
2	4.0%<N≤5.5%	0.3%
3	5.5%<N≤7%	0.7%
4	7%<N	1.0%

基金管理费以封闭期最后一日资产净值为基数,在管理费计提日计提,管理费计提日结束后由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于管理费计提日结束后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、公休日等,支付日期顺延。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,301,729.30

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.18%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.18%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 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取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	859,628.93
中国工商银行股份有限公司(托管人)	2,934,083.23
合计	3,793,712.16

注:本基金的销售服务费年费率为0.50%。本基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。销售服务费额计算方法如下:

M=E×0.50%÷当年天数

M为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,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款指令, 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取,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	42,750,000.00	2,459.59

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	7,691,014.49	34,711.83

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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人民币599,268,116.84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
041352040	13建发CP001	2014年7月1日	100.91	500,000	50,455,000.00
041352041	13京能CP001	2014年7月1日	100.98	500,000	50,490,000.00
041353080	13宁交建CP001	2014年7月1日	101.22	500,000	50,610,000.00
041360073	13杉杉CP002	2014年7月1日	100.83	300,000	30,249,000.00
041360083	13钱江水利CP001	2014年7月1日	101.36	200,000	20,272,000.00
041360085	13漳州交运CP001	2014年7月1日	101.29	200,000	20,258,000.00
041361047	13渝高科CP001	2014年7月1日	100.95	150,000	15,142,500.00
041372007	13锡产业CP002	2014年7月1日	101.37	250,000	25,342,500.00
130229	13国开29	2014年7月1日	97.52	500,000	48,760,000.00
130238	13国开38	2014年7月1日	99.33	1,000,000	99,330,000.00
140202	14国开02	2014年7月1日	103.97	200,000	20,794,000.00
041362042	13黑牡丹CP001	2014年7月4日	101.21	300,000	30,363,000.00
041359074	13闽交运CP003	2014年7月14日	100.93	500,000	50,465,000.00
041359075	13巨石CP002	2014年7月14日	101.09	500,000	50,545,000.00
041359078	13桂铁投CP001	2014年7月14日	101.40	500,000	50,700,000.00
041360069	13合工投CP001	2014年7月14日	100.93	40,000	4,037,200.00
合计				6,140,000	617,813,200.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额350,000,000.00元,于2014年7月1日及2014年7月7日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.公允价值

(1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。

(2)以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。

②各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为40,400,000.00元,属于第二层级的余额为3,452,974,000.00元,无属于第三层级的余额(于2013年12月31日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为1,836,837,000.00元,无属于第一层级和第三层级的余额。)。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级, 上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外,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	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	3,493,374,000.00	97.33
	其中:债券	3,493,374,000.00	97.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,001,365.87	0.22
7	其他各项资产	87,791,038.91	2.45
8	合计	3,589,166,404.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	168,884,000.00	6.40
	其中:政策性金融债	168,884,000.00	6.40
4	企业债券	751,001,000.00	28.47
5	企业短期融资券	1,926,851,000.00	73.04
6	中期票据	646,638,000.00	24.51
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,493,374,000.00	132.43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	130238	13国开38	1,000,000	99,330,000.00	3.77
2	1380367	13邯郸城投债	500,000	52,670,000.00	2.00
3	1380373	13宁德国投债	500,000	52,460,000.00	1.99
4	101364012	13泰交通MTN001	500,000	52,015,000.00	1.97
5	101459003	14嘉实投MTN001	500,000	51,465,000.00	1.95

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.6 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.10.7 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.8 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.6 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.7 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的股票。

7.11.8 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	应收股利	-
4	应收利息	87,791,038.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,791,038.91

7.11.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.10 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

序号	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者			个人投资者		