民生加银现金宝货币市场基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:民生加银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月22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2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	民生加银现金宝货币
基金主代码	000371
交易代码	000371
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月18日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,294,421,904.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在充分控制基金资产风险,保持基金资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金的投资将以保证资产的安全性和流动性为基本原则, 力求在对国内外宏观经济走势、货币财政政策变动等因素充分评估的基础上,科学预计未来利率走势,择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具,进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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		民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	田青
	联系电话	0755-23999888	010-67595096
	电子邮箱	linhai@msjyfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096
传真		0755-23999800	010-66275853

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.msjyfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	74,820,321.54
本期利润	74,820,321.54
本期净值收益率	2.7009%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末基金资产净值	7,294,421,904.80
期末基金份额净值	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。

②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本基金无持有入认购或交易基金的各项费用。

④本基金按日结转份额。

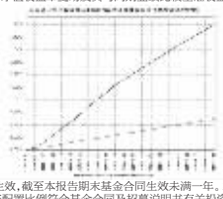
3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去一个月	0.3872%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	0.2762%	0.0009%
过去三个月	1.2041%	0.0009%	0.3366%	0.0000%	0.8675%	0.0009%
过去六个月	2.7009%	0.0023%	0.6695%	0.0000%	2.0314%	0.0023%
自基金合同生效起至今	3.8335%	0.0034%	0.9468%	0.0000%	2.8867%	0.0034%

注:业绩比较基准=七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自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:本基金合同于2013年10月18日生效,截至本报告期末基金合同生效未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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

民生加银基金管理有限公司(以下简称“公司”)是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。经中国证监会[2008]1187号文批准,于2008年11月3日在深圳正式成立,2012年注册资本增加至3亿元人民币。

截至2014年6月30日,公司共管理20只开放式基金:民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选股票型证券投资基金、民生加银稳健成长股票型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、民生加银景气行业股票型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银和极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银家盈理财7天债券型证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银家盈理财月度债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金。

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		
杨林耘	民生加银信用双利债券基金、民生加银平稳增利基金、民生加银现金增利货币基金、民生加银家盈理财7天基金、民生加银家盈理财月度基金、民生加银现金宝货币基金的基金经理	2014年4月3日	-	20	曾任东方基金基金经理(2008年-2013年),中国外贸信托高级投资经理、部门副总经理,泰康人寿投资部高级投资经理,武汉融利期货首席交易员、研究部副经理。自2013年10月加盟民生加银基金管理有限公司。
乐瑞枫	民生加银增强收益债券基金、民生加银景气行业股票基金、民生加银信用双利债券基金、民生加银转债优选基金、民生加银策略精选混合基金、民生加银现金宝货币基金的基金经理;公司投资部副总监	2013年10月18日	-	10	复旦大学数量经济学硕士。自2002年起任衡泰软件定量研究部定量分析师、从事固定收益产品定价及风险管理系统开发工作;2004年加入博时基金管理有限公司,任固定收益部基金经理助理,从事固定收益投资及研究业务;2009年加入本公司,曾任基金经理助理。

注:①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从《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

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

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

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善了公司公平交易制度,制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,同时包括投权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节,形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易,公司启用了交易系统中的公平交易程序,在指令分发及指令执行阶段,均由系统强制执行公平委托;此外,公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

对于场外交易,公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

本报告期内,本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金未发现可能的异常交易情况,不存在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成交量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

2014年上半年,宏观经济呈现平衡偏弱的态势。PMI指数、工业增加值、发电量等经济指标全部走弱,显示经济从2013年四季度开始回落, 直至2014年二季度未经济才开始出现低位企稳迹象。同时物价指数CPI和PPI在一季度快速下滑后开始小幅回升,显示整体上半年通胀压力不大。经济的疲软也让国内的货币政策逐步转向宽松,上半年货币市场流动性整体宽松,央行公开市场实现资金净投放。

由于流动性整体宽松,上半年以来债券市场配置热情高涨,长短端收益率整体下行,收益率曲线变平。利率债方面,1年期国债收益率下行至3.15%;10年期国债收益率下行至4.06%。信用债品种收益率也均呈现下行,中等评级、中长久期表现最优。

货币类基金主要投资于短期债券、银行间市场质押式回购和银行协议存款。上半年本基金通过对客户需求和市场情况的判断,合理安排组合现金流,保证了充足的流动性。

民生加银现金宝货币市场基金在本报告期内,一是增加了短融的配置比例;二是在季末加大协议存款的配置比例,三是做好流动性管理工作。同时,跟踪央行的货币政策,对固定收益类资产配置进行灵活调整,为投资者获取更高的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为2.7009%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

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年三季度,在稳增长政策的影响下,三季度经济同比增速有望进一步弱势反弹,经济基本面对于债市影响中性。同时为了防止经济增速继续下滑,货币政策将继续有所作为,特别是在支持保障房建设等方面,需要央行维持流动性稳定,加大定向宽松和窗口指导力度。目前对债市有利的方面是流动性向能推持相对宽松,不利因素在于债券市场对经济增速的悲观预期将会修正,对采取大幅宽松政策的乐观预期也将修正。同时经济增速的放缓将对部分企业的财务状况造成压力,低等级债券的信用风险将升高。

综上所述,本基金将合理控制资产剩余期限,继续保持组合较高的流动性,以短融、协议存款为主要投资对象,择机提高中高等级信用债券品种的配置比例,在保证流动性安全的前提下提高组合收益。并且,我们会实时关注公开市场操作和货币政策的变化,进一步做好流动性管理。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基于此,本基金管理人为了确保估值工作的合规开展,建立了负责估值工作决策和执行的专门机构,组成人员包括分管运营的公司领导、督察长、投资总监、运营管理部、交易部、研究部、投资部、监察稽核部各部门负责人及其指定的相关人员。研究部参加人员应包含金融工程小组及相关行业研究员。分管运营的公司领导任估值小组组长。且基金经理不参与其管理基金的相关估值业务。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。据本基金基金合同中收益分配有关原则的规定:本基金根据每日基金收益公告,以每万份基金份额收益为基准,为投资人每日计算收益并分配,每日进行支付。本报告期内本基金应分配利润74,820,321.54元,报告期内已分配利润74,820,321.54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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为74,820,321.54元。

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

本托管人复核审查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。

§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:民生加银现金宝货币市场基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	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	6.4.7.1	4,881,460,581.14	450,645,336.13
结算备付金		-	89,523.81
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,141,602,110.45	34,869,800.88
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,141,602,110.45	34,869,800.88
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,737,005,509.50	170,400,997.75
应收证券清算款		30,621,395.75	-
应收利息	6.4.7.5	48,000,286.78	1,676,334.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,838,689,883.62	657,681,993.47
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,537,446,693.82	-
应付证券清算款		-	3,800,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,893,774.32	47,449.32
应付托管费		505,006.49	12,653.16
应付销售服务费		1,578,145.26	39,541.09
应付交易费用	6.4.7.7	61,986.28	1,666.25
应交税费		-	-
应付利息		903,719.56	-
应付利润		1,142,200.18	129,170.15
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	736,452.91	21,500.00
负债合计		1,544,267,978.82	4,051,979.97
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	7,294,421,904.80	653,630,013.50
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,294,421,904.80	653,630,013.50
负债和所有者权益总计		8,838,689,883.62	657,681,993.47

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额7,294,421,904.80份。

6.2 利润表

会计主体:民生加银现金宝货币市场基金

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	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一,收入		87,761,912.58	-
1.利息收入		85,858,724.24	-
其中:存款利息收入	6.4.7.11	48,613,219.46	-
债券利息收入		20,594,345.39	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,651,159.39	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,903,188.34	-
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,903,188.34	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二,费用		12,941,591.04	-
1.管理人报酬	6.4.9.2.1	4,475,311.45	-
2.托管费	6.4.9.2.2	1,193,416.37	-
3.销售服务费	6.4.9.2.3	3,729,426.28	-
4.交易费用	6.4.7.19	-	-
5.利息支出		3,401,127.48	-
其中:卖出回购金融资产支出		3,401,127.48	-
6.其他费用	6.4.7.20	142,309.46	-
三,利润总额(亏损总额以“-”号填列)		74,820,321.54	-
减:所得税费用		-	-
四,净利润(净亏损以“-”号填列)		74,820,321.54	-

注:本基金合同于2013年10月18日生效。因此,无对比期间财务报表数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:民生加银现金宝货币市场基金

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)	653,630,013.50	-	653,630,013.50
二,本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	74,820,321.54	74,820,321.54
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)	6,640,791,891.30	-	6,640,791,891.30
其中:1.基金申购款	25,824,243,856.21	-	25,824,243,856.21
2.基金赎回款	-19,183,451,964.91	-	-19,183,451,964.91
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)	-	-74,820,321.54	-74,820,321.54
五,期末所有者权益(基金净值)	7,294,421,904.80	-	7,294,421,904.80
项目	上年度可比期间 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)	-	-	-
二,本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金合同于2013年10月18日生效。因此,无对比期间财务报表数据。

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:

俞竹曦 弭洪军 洪锐珠

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

民生加银现金宝货币市场基金(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”)证监许可[2013]1244号《关于核准民生加银现金宝货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人民生加银基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2013年10月18日正式生效,首次设立募集规模为300,033,165.19份基金份额,其中认购资金利息折合12,500.79份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司,注册登记机构为民生加银基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据,期限在一年以内(含一年)的银行定期存款与大额存单,剩余期限在一年以内(含一年)的中央银行票据与债券回购,剩余期限在397天以内(含397天)的债券,剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,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。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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》的规定,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、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《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》,自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	3,510,581.14
定期存款	4,877,950,000.00
其中:存款期限1-3个月	1,753,000,000.00
存款期限3个月-1年	3,124,950,000.00
其他存款	-
合计:	4,881,460,581.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2014年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,141,602,110.45	2,139,104,000.00	-2,498,110.45	-0.0342%
	合计	2,141,602,110.45	2,139,104,000.00	-2,498,110.45	-0.0342%

注:偏离金额=影子定价-摊余成本;偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
买入返售证券_银行间	1,737,005,509.50	-
合计	1,737,005,509.50	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	33,099.38
应收定期存款利息	21,051,271.90
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	18,326,684.39
应收买入返售证券利息	8,589,231.11
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	48,000,286.78

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	61,986.28
合计	61,986.28

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	108,341.35
其他应付款	628,111.56
合计	736,452.91

注:其他应付款为预收待摊季度结息款。

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	653,630,013.50	653,630,013.50
本期申购	25,824,243,856.21	25,824,243,856.21
本期赎回(以“-”号填列)	-19,183,451,964.91	-19,183,451,964.91
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	7,294,421,904.80	7,294,421,904.80

注:申购含红利再投份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	74,820,321.54	-	74,820,321.54
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中:基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-74,820,321.54	-	-74,820,321.54
本期末	-	-	-

注:本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配,每日以红利再投资方式集中支付收益,即按份额面值1.00元转为基金份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	54,810.19
定期存款利息收入	48,512,648.86
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	354.75
其他	45,405.66
合计	48,613,219.46

6.4.7.12 股票投资收益

本基金于本期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	744,314,927.86
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	735,590,784.30
减:应收利息总额	6,820,955.22
债券投资收益	1,903,188.34

6.4.7.14贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金于本期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金于本期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金于本期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

本基金于本期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
债券帐户维护费	13,500.00
银行费用	48,568.11
其他费用	900.00
合计	142,309.46

6.4.7.21 分部报告

截至本期末,本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务,因此,无需作披露的分部报告。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本基金本报告期不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。

6.4.8.2 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
民生加银基金管理有限公司(“民生加银基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
中国民生银行股份有限公司(“中国民生银行”)	基金管理人的股东、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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同于2013年10月18日生效。因此,无对比期间数据。

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

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管理费	4,475,311.45
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.30%/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

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。

2) 基金管理费于2014年上半年末尚未支付的金额为人民币1,893,774.32元,于2013年末尚未支付的金额为人民币47,449.32元。

6.4.9.2.2 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	1,193,416.37

注:1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.08%/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

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。

2) 基金托管费于2014年上半年末尚未支付的金额人民币为505,006.49元,于2013年末尚未支付的金额人民币为12,653.16元。

6.4.9.2.3 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 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
民生加银基金公司	3,729,426.28
合计	3,729,426.28

注:民生加银现金宝货币市场基金基金份额销售服务费年费率为0.25%。本基金销售服务费计提的计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,按月支付给民生加银基金公司,再由民生加银基金公司计算并支付给各基金销售机构。

6.4.9.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	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
中国建设银行	-	-	-	-	634,662,000.00	255,255.40

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日(2013年10月18日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	25,109,760.23
期间因拆分变动份额	-
减:期间赎回/卖出总份额	20,000,000.00
期末持有的基金份额	5,109,760.23
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.07%

注:申购/买入含红利再投份额。

6.4.9.4.2 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

本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.9.5 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

项目	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
中国建设银行	3,510,581.14	54,810.19
中国民生银行	-	926,978.11

注:1)本基金本期的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息,利息收入为人民币54,810.19元。

2)本基金本期由中国民生银行保管的定期存款按银行约定利率计息,利息收入为人民币926,978.11元。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日				
	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
中国建设银行	041454012	14红豆CP001	余额包销	400,000	40,000,000.00
中国民生银行	041452033	14