

天弘增利宝货币市场基金

【2014】半年度报告摘要

了信用风险等发生。本基金在报告期内坚守“稳健理财”的投资理念,为持有人创造了稳健、合理的收益。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截至2014年6月30日,本基金本报告期份额净值收益率2.6778%,同期业绩比较基准收益率0.6810%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简单展望

展望2014年下半年,前期积极财政政策,相对宽松货币政策初见成效,短期来看经济已经开始企稳回升,但受制于房地产下行周期,长期来看经济仍面临较大下行压力,因此仍需政策层面给予配合,货币政策难以实质性宽松,物价方面,受食品价格企稳及CPI翘尾因素影响,今年4季度开始,通胀将面临较大压力,受制于通胀压力,货币政策难以大幅全面宽松;综合来看,货币政策有望继续通过定向宽松方式维持中性基调,资金面有望维持平稳。对债券和货币市场而言,债券收益率受供需格局影响大幅下行空间不足,货币政策定向宽松背景下,短端货币市场利率有望低位震荡,存款利率、短期融资券利率有望维持平稳,但受新税种等因素影响,不排除个别时点资金利率超预期上行的可能,届时将带动货币市场投融资利率的上行。

本基金将继续秉承“稳健理财”的投资理念,严格控制好流动性风险、信用风险及价格风险,将大数据分析和市场全面判断有机结合起来,根据互联网货币基金的独有特点,灵活调整组合配置,在风险控制的基础上,继续为持有人创造持续、稳定、合理的收益。

4.6 管理人对于报告期内基金投资运作事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已实施的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准估值政策、方法和流程的变更和执行,确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理专员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金估值作为基金估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关权益及定价方案的意见建议或参与,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终决策权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人(该收益参与与下一日的收益分配),并按自然日结转至基金份额持有人下的基金账户。

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

自2013年6月20日天弘增利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)成立以来,作为本基金的托管人,中信银行严格遵照了《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行办法》及其他有关法律法规和基金合同的各项规定,尽到了诚实履行了托管人应尽的义务,不存在任何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、净值计算等情况的说明

报告期内,本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议的要求,对基金管理人—天弘基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督,对基金资产每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容内容的真实性、准确性和完整性发表意见

由本基金管理人—天弘基金管理有限公司编制,并经本托管人复核检查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告等内容真实、准确和完整。

5.6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:天弘增利宝货币市场基金

报告截止日:2014年6月30日

项目	附注号	本报告 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	501,446,435,713.37	175,541,017,053.14
结算备付金		61,273,000.01	—
存出保证金		—	—
交易保证金	6.4.7.2	33,224,175,455.08	12,762,065,913.59
应收款项		409,968,411.16	—
预付款项		—	—
应收利息		32,814,207,043.92	12,762,065,913.59
应收股利		—	—
其他资产		—	—
资产总计		589,111,690,651.73	190,375,786,128.89
负债和所有者权益:			
短期借款		—	—
应付账款		—	—
预收账款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	6,999,996,560.00	4,949,996,640.00
应付证券清算款		7,645,203,101.91	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		145,144,043.31	39,100,241.16
应付托管费		38,705,078.21	10,426,730.96
应付销售服务费		120,953,569.42	32,583,534.31
应付交易费用	6.4.7.7	196,210.96	101,301.04
应付税费		—	—
应付利息		761,172.06	1,327,955.44
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	331,738.04	234,000.00
负债合计		14,951,291,279.91	5,033,770,402.91
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	574,160,399,371.82	185,342,015,725.98
资本公积	6.4.7.10	574,160,399,371.82	185,342,015,725.98
所有者权益合计		574,160,399,371.82	185,342,015,725.98
负债和所有者权益总计		589,111,690,651.73	190,375,786,128.89

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.00元,基金份额总额674,160,399,371.82份。

6.2 利润表

会计主体:天弘增利宝货币市场基金

本报告期:2014年1月1日—2014年6月30日

项目	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 (基金合同生效日)至2013年6月30日
一、收入		14,079,867,873.32	6,347,915.05
1.利息收入		14,029,054,494.86	6,347,915.05
其中:存款利息收入	6.4.7.11	12,507,071,248.25	6,315,248.43
债券利息收入		391,878,107.87	—
资产支持证券利息收入		1,865,931.71	—
其他利息收入		129,141,207.33	32,666.62
2.投资收益(损失以“-”号填列)		49,588,083.93	—
其中:股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	49,588,083.93	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		—	—
3.汇兑收益(损失以“-”号填列)		—	—
4.其他收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	125,294.53	—
二、费用		1,531,444,507.98	604,143.48
1.管理费		724,488,243.54	271,263.98
2.托管费		193,188,864.91	72,369.08
3.销售服务费		603,715,203.01	226,153.33
4.其他费用	6.4.7.15	—	—
5.利息支出		9,542,872.63	—
其中:卖出回购金融资产支出		9,542,872.63	—
6.其他费用	6.4.7.16	539,323.26	34,237.09
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12,548,223,365.34	5,743,771.57
减:所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12,548,223,365.34	5,743,771.57

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘增利宝货币市场基金

本报告期:2014年1月1日—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	上期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	185,342,015,725.98	—
二、本期投资运作产生的基金净值变动(本期利润)	—	12,548,223,365.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(扣除申购费、赎回费、销售服务费后的净增加)	388,818,383,645.84	—
其中:1.基金申购费	1,639,884,060,685.08	—
四、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-1,251,065,677,039.24	—
其中:1.基金申购费	1,639,884,060,685.08	—
五、期末所有者权益(基金净值)	574,160,399,371.82	574,160,399,371.82

项目	上年度可比期间 2013年5月29日至(基金合同生效日)至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年5月29日至(基金合同生效日)至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	200,628,721.85	200,628,721.85
二、本期投资运作产生的基金净值变动(本期利润)	—	5,743,771.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动(扣除申购费、赎回费、销售服务费后的净增加)	4,043,505,511.84	—
其中:1.基金申购费	5,061,577,368.05	—
四、本期基金份额持有人申购/赎回/转换产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-1,018,071,856.21	—
其中:1.基金申购费	—	-5,743,771.57
五、期末所有者权益(基金净值)	5,043,505,511.84	5,743,771.57