# 银华交易型货币市场基金

## [2014] 半年度报告摘要

基金管理人:银华基金管理有限公司
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27日

§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25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

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 银华交易型货币市场基金 |
| 基金简称 | 银华交易型货币 |
| 场内简称 | 银华日利 |
| 基金主代码 | 511880 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年4月1日 |
| 基金管理人 | 银华基金管理有限公司 |
| 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 | 69,722,060.00份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2013-04-18 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在保持本金低风险的前提下,力求实现高流动性和高于业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金将以市场价值分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,以久期为核心的资产配置、品种与类属选择,结合对货币市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,力争为投资人创造稳定的收益。 |
| 业绩比较基准 | 活期存款利率(税后)。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |

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 | | 银华基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 凌宇翔 | 田青 |
| | 联系电话 | (010)58163000 | (010)67595096 |
| | 电子邮箱 | yhjj@yhfund.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4006783333,(010)85186558 | (010)67595096 |
| 传真 | | (010)58163027 | (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.yhfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人办公地址 |

§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 | 125,258,346.66 |
| 本期利润 | 125,258,346.66 |
| 本期净值收益率 | 2.3384% |
| 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 | 7,137,023,590.53 |
| 期末基金份额净值 | 102.364 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 累计净值收益率 | 5.6399% |

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,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。

2、本基金采用收益不结转份额的全价计价方式,因此本报告中披露的净值收益率指标实际上为本基金净值增长率,同时增加披露以下财务指标:

(1)加权平均基金份额本期利润:2.1360

(2)本期加权平均净值利润率:2.10%

(3)期末可供分配利润:164,808,420.83元

(4)期末可供分配基金份额利润:2.3638元

3、本基金于2013年4月3日进行了份额折算,折算后本基金份额面值由初始1.000元调整为100.000元

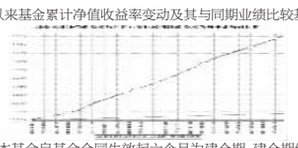
3.2 基金净值表现

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 | 0.3598% | 0.0078% | 0.0297% | 0.0010% | 0.3301% | 0.0068% |
| 过去三个月 | 1.0723% | 0.0105% | 0.0873% | 0.0010% | 0.9850% | 0.0095% |
| 过去六个月 | 2.3384% | 0.0154% | 0.1737% | 0.0010% | 2.1647% | 0.0144% |
| 过去一年 | 4.8680% | 0.0146% | 0.3506% | 0.0010% | 4.5174% | 0.0136% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.6399% | 0.0147% | 0.4382% | 0.0010% | 5.2017% | 0.0137% |

注:本基金采用收益不结转份额的全价计价方式,因此本报告中披露的净值收益率指标实际上为本基金净值增长率。

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:按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已达到基金合同规规定。

§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

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日,是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为2亿元人民币,公司的股东及其出资比例分别为:西南证券股份有限公司49%、第一创业证券股份有限公司29%、东北证券股份有限公司21%及山西海鑫实业股份有限公司1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至2014年6月30日,本基金管理人管理着40只证券投资基金,具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯88精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深300指数分级证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重90指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证50等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票50指数债券型证券投资基金(LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合30/70指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证800等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金。同时,本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

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 | | |
| 朱哲先生 | 本基金的基金经理 | 2013年10月17日 | - | 4.5年 | 经济学学士。曾任职于中国银行,担任助理投资经理职务;并曾任职于嘉实基金管理有限公司,担任交易员职务。2013年5月加盟银华基金管理有限公司,曾担任固定收益部基金经理助理职务。自2013年10月17日起兼任银华货币市场证券投资基金基金经理,自2014年4月25日起兼任银华多利宝货币市场基金基金经理,自2014年6月23日起兼任银华活钱宝货币市场基金基金经理。具有从业资格。国籍:中国。 |
| 于海颖女士 | 本基金的基金经理 | 2013年4月1日 | 2014年4月25日 | 9.5年 | 硕士学位。曾在深圳创维集团集团人事部、深圳开发科技股份有限公司人力资源部工作,历任北方国际信托投资股份有限公司投资部债券研究员、光大保德信基金管理公司投资部基金经理等职。自2007年11月6日至2010年8月31日担任光大保德信货币基金基金经理,2008年10月29日至2010年8月31日担任光大保德信增利收益债券基金基金经理。2010年11月加盟银华基金管理有限公司,2011年6月28日至2013年6月17日期间担任银华永祥保本混合型证券投资基金基金经理,自2011年8月2日至2014年4月25日期间兼任银华货币市场证券投资基金基金经理,自2012年8月9日起兼任银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)基金经理,自2013年8月7日起兼任银华信用四季红债券型证券投资基金基金经理,自2013年9月18日起兼任银华信用季季红债券型证券投资基金基金经理,自2014年5月8日起兼任银华信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理。具有从业资格。国籍:中国。 |
| 哈默女士 | 本基金的基金经理 | 2014年6月23日 | - | 7年 | 学士学位。2007年7月加盟银华基金管理有限公司,历任股票交易员、债券交易员等职位,具有从业资格。国籍:中国。 |

注:1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

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。

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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华交易型货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等,并建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节,本基金管理人实行集中交易制度,按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节,本基金管理人定期对股票交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济数据延续一季度的疲弱状态。面对经济下行压力,政府保增长的意愿逐渐增强,央行也着力维持货币市场稳定性。同时,美国等国家复苏势头也进一步确立。在基建和出口的拉动下,从二季度开始工业增加值、PMI以及进出口等数据开始回升。整体来看,除了春节前资金面较为紧张外,上半年货币市场保持极度宽松的状态,短融收益率和协议存款利率较去年四季度大幅下行。

本基金合理安排现金流,顺利的应对了上半年各个关键时点的赎回。在春节前和半年末资金面紧张的时机配置了一些长久期短融与存款,在保证组合的流动性的同时提升组合的静态收益。

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102.364元,本报告期份额净值增长率为2.3384%,同期业绩比较基准收益率为0.1737%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,虽然在政府一系列保增长政策的支撑下,近期工业增加值、PMI等数据有所回升。但是房地产市场状况依然严峻,销售情况不佳,同时百城住宅价格指数等价格指标还在加速下行。在这种背景下,经济增长依然面临向下的压力。因此,预计下半年宏观政策依然会偏向于保持经济增长速度的稳定,央行的货币政策方面也不会发生大的变化,货币市场依然会维持比较宽松的状态。但是新股发行将会造成场内资金利率波动。随着监管加强,银行同业业务增长速度放缓,对协议存款的需求也将进一步减少,协议存款利率可能会长期在低位徘徊。目前短融收益率依然处在相对高位,与融资成本相比还有不小的套利空间,因此会受到货币基金的追捧,收益率具有进一步下行的空间。但是,今年以来信用事件不断发生,因此低评级短融收益率可能会出现分化,资质较差的品种可能会面临一定的压力。

基于上述分析,本基金接下来将继续根据组合的规模波动进行组合的调整,在充分预防可能出现的流动性压力前提下,密切关注货币类基金相关政策方面的变化,抓住关键投资机会进行资产配置,合理安排现金流,为场内投资者提供较其他现金管理工具更有吸引力的收益。同时密切关注新股发行和转债发行动态,把握场内投资者需求,提高组合流动性管理水平。

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》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由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目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会(委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干),负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务;估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人已于2014年1月13日发布分红公告,向截至2014年1月16日止在本基金注册登记机构登记在册的本基金全体份额持有人,按每10份基金份额派发红利32.080元,实际分配收益金额为人民币20,934,830.61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20,934,830.61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:银华交易型货币市场基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 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 | 4,779,232,635.97 | 426,804,305.43 |
| 结算备付金 | 52,522,921.78 | 2,073,809.52 |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 1,240,533,529.79 | 79,977,586.84 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,240,533,529.79 | 79,977,586.84 |
| 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 | 1,210,545,055.82 | 125,550,868.33 |
| 应收证券清算款 | 142.80 | - |
| 应收利息 | 39,148,710.36 | 3,475,890.99 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | 33,398.25 | - |
| 资产总计 | 7,322,016,394.77 | 637,882,461.11 |
| 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 | 179,299,710.35 | 46,724,576.64 |
| 应付证券清算款 | - | 46,160,588.89 |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 2,587,622.42 | 140,213.09 |
| 应付托管费 | 776,286.73 | 42,063.94 |
| 应付销售服务费 | 2,156,352.04 | 116,844.24 |
| 应付交易费用 | 74,766.17 | 5,864.31 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 14,682.77 | 4,316.16 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 83,383.76 | 59,000.00 |
| 负债合计 | 184,992,804.24 | 93,253,467.27 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 6,972,215,169.70 | 527,700,545.46 |
| 未分配利润 | 164,808,420.83 | 16,928,448.38 |
| 所有者权益合计 | 7,137,023,590.53 | 544,628,993.84 |
| 负债和所有者权益总计 | 7,322,016,394.77 | 637,882,461.11 |

注:1、报告截止日2014年6月30日,基金份额净值为人民币102.364元,基金份额总额69,722,060.00份。

6.2 利润表

会计主体:银华交易型货币市场基金

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 | 上年度可比期间 2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 146,815,952.19 | 8,056,157.19 |
| 1.利息收入 | 141,163,343.70 | 7,412,585.30 |
| 其中:存款利息收入 | 78,484,149.87 | 5,557,038.68 |
| 债券利息收入 | 45,295,662.68 | 742,642.89 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 17,383,531.15 | 1,112,903.73 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 5,652,608.49 | 79,692.23 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 5,652,608.49 | 79,692.23 |
| 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) | - | - |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | - | 563,879.66 |
| 减:二、费用 | 21,557,605.53 | 1,509,933.62 |
| 1.管理人报酬 | 8,665,445.67 | 680,376.40 |
| 2.托管费 | 2,599,633.74 | 204,112.92 |
| 3.销售服务费 | 7,221,204.74 | 566,980.35 |
| 4.交易费用 | - | - |
| 5.利息支出 | 2,898,206.07 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 2,898,206.07 | - |
| 6.其他费用 | 173,115.31 | 58,463.95 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 125,258,346.66 | 6,546,223.57 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 125,258,346.66 | 6,546,223.57 |

注:本基金上年度可比期间财务报表的实际编制期间系2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日止。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:银华交易型货币市场基金

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) | 527,700,545.46 | 16,928,448.38 | 544,628,993.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 125,258,346.66 | 125,258,346.66 |
| 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) | 6,444,514,624.24 | 43,556,456.40 | 6,488,071,080.64 |
| 其中:1.基金申购款 | 15,698,769,649.14 | 232,014,157.79 | 15,930,783,806.93 |
| 2.基金赎回款 | -9,254,255,024.90 | -188,457,701.39 | -9,442,712,726.29 |
| 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) | - | -20,934,830.61 | -20,934,830.61 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 6,972,215,169.70 | 164,808,420.83 | 7,137,023,590.53 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013年4月1日(基金合同生效日)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) | 2,201,044,000.00 | - | 2,201,044,000.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 6,546,223.57 | 6,546,223.57 |
| 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) | -1,971,303,918.65 | -4,855,005.41 | -1,976,158,924.06 |
| 其中:1.基金申购款 | 147,139,534.35 | 312,620.06 | 147,452,154.41 |
| 2.基金赎回款 | -2,118,443,453.00 | -5,167,625.47 | -2,123,611,078.47 |
| 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) | 229,740,081.35 | 1,691,218.16 | 231,431,299.51 |

注:本基金上年度可比期间财务报表的实际编制期间系2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日止。

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:

_____王立新_____ _____杨清_____ _____龚飒_____

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 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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 |
|---|---|
| 东北证券股份有限公司("东北证券") | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 第一创业证券股份有限公司("第一创业") | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 银华基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人、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。

6.4.4 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

注:本基金本报告期及上年度可比会计期间(2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日)均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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 | 上年度可比期间 2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,665,445.67 | 680,376.40 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 4,765,442.29 | 325,199.61 |

注: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为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

本基金上年度可比会计期间数据的实际编制期间系2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日止。

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 | 上年度可比期间 2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,599,633.74 | 204,112.92 |

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.09%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.09%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

本基金上年度可比会计期间数据的实际编制期间系2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日止。

6.4.4.2.3 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 |
| 银华基金管理有限公司 | 911,578.72 |
| 东北证券股份有限公司 | 102,343.59 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 98,920.36 |
| 合计 | 1,112,842.67 |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间 2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 银华基金管理有限公司 | 80,456.84 |
| 东北证券股份有限公司 | 31,861.04 |
| 第一创业证券股份有限公司 | - |
| 合计 | 112,317.88 |

注:基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。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为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

本基金上年度可比会计期间数据的实际编制期间系2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日止。

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

注:本基金本报告期及上年度可比会计期间(2013年04月01日(基金合同生效日)至2013年6月30日)均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

注:本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比会计期间(2013年04月01日(基金合同生效日)至2013年06月30日)均未运用固有资金投资本基金份额。

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

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2014年6月30日 | | 上年度末 2013年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司("第一创业") | 493,000.00 | 0.7100% | - | - |
| 西南证券股份有限公司("西南证券") | - | - | 5,286.00 | 0.1000% |

注:除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 | | 上年度可比期间 2013年4月1日(基金合同生效日)至2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 89,232,635.97 | 203,495.61 | 4,137,179.72 | 304,317.62 |

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比会计期间(2013年04月01日(基金合同生效日)至2013年06月30日)均未存在其他关联交易事项。

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

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末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179,299,710.35元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 130314 | 13进出14 | 2014年7月1日 | 99.96 | 400,000 | 39,984,513.87 |
| 130418 | 13农发18 | 2014年7月1日 | 99.98 | 400,000 | 39,992,608.22 |
| 140207 | 14国开07 | 2014年7月1日 | 100.42 | 200,000 | 20,083,366.89 |
| 140212 | 14国开12 | 2014年7月1日 | 100.00 | 500,000 | 49,999,109.03 |
| 140429 | 14农发29 | 2014年7月1日 | 100.17 | 400,000 | 40,069,530.12 |
| 合计 | | | | 1,900,000 | 190,129,128.13 |

注:其中期末估值总额等于相应质押债券的期末摊余成本。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

注:本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 | 固定收益投资 | 1,240,533,529.79 | 16.94 |
| | 其中:债券 | 1,240,533,529.79 | 16.94 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,210,545,055.82 | 16.53 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,831,755,557.75 | 65.99 |
| 4 | 其他各项资产 | 39,182,251.41 | 0.54 |
| 5 | 合计 | 7,322,016,394.77 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 3.08 |
| | 其中:买断式回购融资 | | - |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 179,299,710.35 | 2.51 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

7.3.1 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内债券正回购的资金余额未有超过基金资产净值20%的情况。

7.4 基金投资组合平均剩余期限

7.4.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限???????? | 107 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 107 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 34 |

7.4.2 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过180天的情况。

7.4.3 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 22.18 | 2.51 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 16.24 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 25.36 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 21.02 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 17.24 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 102.04 | 2.51 |

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 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 360,221,025.61 | 5.05 |
| | 其中:政策性金融债 | 360,221,025.61 | 5.05 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 880,312,504.18 | 12.33 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 1,240,533,529.79 | 17.38 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 071402004 | 14国泰君安CP004 | 1,200,000 | 119,996,986.70 | 1.68 |
| 2 | 041456031 | 14陕交建CP001 | 1,000,000 | 100,000,094.58 | 1.40 |
| 3 | 011415005 | 14中铝业SCP005 | 1,000,000 | 99,951,732.70 | 1.40 |
| 4 | 041464036 | 14张资产CP001 | 900,000 | 90,071,373.68 | 1.26 |
| 5 | 041460035 | 14厦路桥CP001 | 700,000 | 70,134,791