

# 信息披露 Disclosure

## 农银汇理7天理财债券型证券投资基金

### 【2014】半年度报告摘要

报告期内未发生本基金存在异常交易行为。

未发生本基金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%的情况。

4.4 管理人对于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业绩分析

报告期内货币市场利率持续下降，短期融资利率持续下降，中债货币市场基金可投资债券指数上半年上涨3.15%，本基金结合各资产结构对市场流动性预期，二季度继续加大债券投资比例，在满足基金流动性需求的基础上，取得超越业绩比较基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

报告期内本基金A 类别份额净收益率为2.4831%，B 类别份额净收益率为2.0051%，同期业绩比较基准收益率为0.6789%。

4.5 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

展望下半年，预计货币市场流动性仍将维持相对宽松的状态，但由于有新股发行的影响，流动性波动将有所加剧。本基金将努力抓住市场流动性波动带来的机会，在波动中加大中期票据的比例。

4.6 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

根据财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》（证监会公告〔2007〕15号）及《关于证券投资基金信息披露编报规则》（证监会公告〔2007〕15号）等文件关于估值的相关规定，本基金根据估值技术对估值进行调整，并建立了估值委员会。

公司参与基金估值的人员及职责：公司估值委员会负责基金估值政策和程序的制定和解释，并定期评估估值政策和程序进行评估，在发生影响估值政策和程序的有效性或适用性的情况，以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资政策或投资新资产时，估值委员会评价具有估值政策和程序的应用，必要时及时进行修订。公司估值委员会根据相关基金估值委员会《估值委员会工作制度》等文件关于估值的认定公司估值政策和程序进行估值。基金估值委员会根据估值的变化，书面提示公司风险控制部运营管理部投资品种在估值调整对基金净值的影响可能达到的程度，风险控制部提交调整估值给运营部，运营部根据调整估值进行调整并记录，并根据估值政策决定是否向估值委员会提交采用新的估值方法。公司估值委员会在通过上述过程进行监督，根据估值政策，具有丰富的基金从业经验和相关专业知识，且之间不存在任何重大利益冲突。基金估值委员会作为公司估值委员会，可以建议调整某一投资品种的估值政策影响，并向投资委员会报告。基金估值委员会对基金估值的利益需求，但是公司估值委员会和风险控制部均受到其影响和调整。如估值委员会未决议，其仅有一票否决权，遵守少数服从多数的原则。

4.7 管理人对于报告期内基金估值调整的说明

本基金根据估值委员会的每日估值情况，以每份基金份额净值为基础，为投资人每日计算日收益并分配，在每个运作周期满中支付。在每个运作周期进行累计收益支付时只以赎回再投资赎回红利冲抵基金净值，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益。报告期内，本基金实施利润分配的金额9498378.24元，其中农银7天理财债券A实施利润分配的金额9498378.24元，农银7天理财债券B实施利润分配的金额9498378.24元，农银7天理财债券C实施利润分配的金额9498378.24元。

5.1 报告期内本基金托管人履职情况说明

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，完全尽到了托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规合规、净值计算、费用计提和支付等情况的说明

本报告期，本托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资金资产净值计算、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进行了监督，未发现基金管理人有关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9498378.24元，其中农银7天理财债券A实施利润分配的金额9498378.24元，农银7天理财债券B实施利润分配的金额9498378.24元，农银7天理财债券C实施利润分配的金额9498378.24元。

5.3 托管人对本基金定期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务信息、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。

6.1 资产负债表

会计主体：农银汇理7天理财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 2014年6月30日 2013年12月31日

资产：

银行存款 2,146,826,018.97 2,034,681,518.92

结算备付金 -- --

存出保证金 -- --

交易性金融资产 559,623,785.03 369,171,151.47

其中：股票投资 -- --

基金投资 -- --

债券投资 559,623,785.03 369,171,151.47

应收支持证券投资 -- --

贵金属投资 -- --

衍生金融资产 -- --

买入返售金融资产 -- 439,381,479.07

应收证券清算款 -- --

应收利息 28,109,648.29 18,729,071.28

应收申购款 -- --

递延所得税资产 31,149,638.49 20,254,690.00

其他资产 -- --

资产总计 2,765,709,090.78 3,162,217,910.74

负债和所有者权益

2014年6月30日 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 29,699,865.15 9,899,875.05

应付证券清算款 -- --

应付赎回款 -- --

应付管理人报酬 921,537.01 862,233.98

应付托管费 273,048.03 255,476.71

应付销售服务费 637,233.13 546,292.19

应付利息 38,125.81 39,976.35

应付增值税 -- --

应付股利 -- --

递延所得税负债 -- --

其他负债 172,495.56 109,000.00

负债合计 31,744,811.40 11,713,771.14

所有者权益：

实收基金 2,733,964,279.38 3,050,504,139.60

未分配利润 -- --

所有者权益合计 2,733,964,279.38 3,050,504,139.60

负债和所有者权益总计 2,765,709,090.78 3,162,217,910.74

注：报告期末于2014年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额2,733,964,279.38份。其中A级：188,790,063.96份，B级：174,215,433.02份。

6.2 利润表

会计主体：农银汇理7天理财债券型证券投资基金  
报告截止日：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目 2014年1月1日至2014年6月30日 2013年1月1日至2013年6月30日

一、收入 106,189,666.55 48,157,591.18

1.利息收入 105,410,964.14 47,836,710.65

其中：存款利息收入 82,416,160.78 41,589,920.30

债券利息收入 11,741,486.96 1,246,261.55

资产支持证券利息收入 -- --

买入返售金融资产收入 11,253,316.40 5,030,528.80

其他利息收入 -- --

2.投资收益（损失以“-”填列） 778,624.41 85,092.87

其中：股票投资收益 -- --

基金投资收益 -- --

债券投资收益 778,624.41 85,092.87

资产支持证券投资收益 -- --

贵金属投资收益 -- --

衍生工具收益 -- --

利息收入 -- --

3.公允价值变动收益（损失以“-”填列） -- --

4.其他收入（损失以“-”填列） -- --

减：二、费用 11,665,728.31 6,371,252.23

1.管理人报酬 5,186,404.98 3,120,363.15

2.托管费 1,536,712.57 924,552.04

3.销售服务费 3,579,679.95 2,136,055.82

4.交易费用 -- --

5.利息支出 1,061,041.02 17,162.41

其中：卖出回购金融资产支出 1,061,041.02 17,162.41

6.其他费用 24,898.79 173,181.61

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） 94,583,878.24 41,786,338.95

减：所得税费用 -- --

四、净利润（净亏损以“-”号填列） 94,583,878.24 41,786,338.95

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理7天理财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 2014年1月1日至2014年6月30日 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） 3,050,504,139.60 --

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） 94,583,878.24 41,786,338.95

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） -316,539,860.22 --

其中：1.基金申购款 26,866,163,851.31 --

2.基金赎回款 -27,182,703,711.53 --

四、本期向基金份额持有人分配利润（净值减少以“-”号填列） -- -94,583,878.24

五、期末所有者权益（基金净值） 2,733,964,279.38 --

项目 2013年2月5日（基金合同生效日）至2013年6月30日 2012年12月31日

一、期初所有者权益（基金净值） 11,783,050,178.39 --

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） -41,786,338.95 41,786,338.95

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） -10,725,385,824.59 --

其中：1.基金申购款 8,732,130,211.17 --

2.基金赎回款 -19,457,516,035.76 --

四、本期向基金份额持有人分配利润（净值减少以“-”号填列） -- -41,786,338.95

五、期末所有者权益（基金净值） 1,057,664,353.80 --

报告期末所有者权益的构成情况

本报告 6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理

基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理 基金管理人：农银汇理