

信诚货币市场证券投资基金

2014 半年度报告摘要

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年08月27日

§1 重要提示

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年08月27日

§1 重要提示

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年08月27日

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年08月27日

§1 重要提示

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年08月27日

§1 重要提示

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年08月27日

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	24.67	9.56
2	30天(含)—60天	11.87	—
3	60天(含)—90天	38.44	—
4	90天(含)—180天	0.95	—
5	180天(含)—397天(含)	24.70	—
6	397天以上	—	—
合计	—	107.28	9.56

7.4期末按债券品种分类的债券投资组合

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	地方政府债	—	—
3	金融债	119,634,410.03	5.67
4	其中:政策性金融债	119,634,410.03	5.67
5	企业债	19,966,596.37	0.95
6	企业短期融资券	812,885,110.07	38.52
7	其他	—	—
8	合计	951,686,116.47	45.14
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,966,596.37	0.95

7.5期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%—0.5%的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2473%
报告期内偏离度的最低值	0.0463%

7.8投资组合报告附注

7.8.1 本基金报告期内无重大关联交易。

7.8.2 本基金报告期内无重大关联交易。

7.8.3 本基金报告期内无重大关联交易。

7.8.4 本基金报告期内无重大关联交易。

8.1期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.2期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.3期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.4期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.5期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.6期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.7期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.8期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.9期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.10期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.10	1.42
10	04145402	14国开(北)	300,000	30,000,855.43	1.42

8.11期末按资产成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	130227	13国债(7)	600,000	59,990,706.12	2.85
2	04162003	14国开(北)	500,000	50,357,344.35	2.39
3	04145309	14国开(北)	500,000	50,001,693.54	2.37
4	04135960	13国债(7)	400,000	40,140,959.35	1.90
5	140319	14国开(北)	400,000	39,639,652.24	1.88
6	04135965	13国债(7)	300,000	30,309,097.46	1.44
7	04135808	13国债(7)	300,000	30,283,827.31	1.44
8	04135409	13国债(7)	300,000	30,079,180.80	1.43
9	04145908	14国开(北)	300,000	30,001,072.	