

信息披露 Disclosure

(上接B044版)

联系电话:021-38637673
传真电话:021-50799507
客户服务电话:95611-3
公司网址: bank.pingan.com
(9) 上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:中国上海市山东一路12号
法定代表人: 葛海蛟
联系人: 高天、姚磊
电话:021-61618888
传真:021-63604196
客户服务热线:95628
公司网址:www.spd.com.cn
(10) 广发银行股份有限公司
注册地址:广东省广州市农林下路 83 号
办公地址:广东省广州市农林下路 83 号
法定代表人:李若虹
客户服务电话:800-830-8003;400-830-8003
网址:www.gdb.com.cn
(11) 兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人: 高建平
网址:http://www.cib.com.cn
客户服务电话:95661 或拨打各城市营业网点咨询电话
(12) 江苏银行股份有限公司
住所:南京市玄武湖北路65号
法定代表人: 黄志伟
公司网站: www.jsbchina.com
客户服务电话:96098,40066-96098
(13) 渤海银行股份有限公司
办公地址:天津市河西区马场道 201-205 号
法定代表人: 刘宝凤
网址:www.cbhb.com.cn
客户服务电话:400 888 8811
(14) 华夏银行股份有限公司
办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人: 吴建
客户服务电话:95677
网址:www.hxb.com.cn
(15) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海浦东新区商城路618号
法定代表人: 万建华
电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人: 芮敬祺
服务热线:400-8888-666
公司网站:www.gtja.com
(16) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508 号
办公地址:上海市静安区新闻路1508 号
法定代表人: 薛峰
联系人: 刘晨、李芳芳
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客户服务热线:95625,400888788,10108998
公司网址:www.ebscn.com
(17) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海淮海中路98号
法定代表人: 王开国
电话:021-23219000
服务热线:95653,400-8888-001或拨打各城市营业网点咨询电话
联系人: 李美琦
公司网址:www.htsec.com
(18) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人: 陈有安
客户服务电话:400-8888-888
电话:010-66568450
联系人: 宋明
公司网址:www.chinastock.com.cn
(19) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区门内大街188号
法定代表人: 王常青
电话:400-8888-108(免长途费)
联系人: 权恒
公司网址:www.csc108.com
(20) 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人: 宫少林
电话:0755-82934666
联系人: 林生迎
客户服务电话:400888111,95565
公司网址:www.newone.com.cn
(21) 广发证券股份有限公司
法定代表人: 孙树树
注册地址: 广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址: 广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
联系人: 黄岚
统一客户服务热线:95675或致电各地营业网点
公司网站:广州广发证券网 http://www.gtfund.com.cn
(22) 长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人: 杨泽洋
电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人: 李真
客户服务热线:95679或4008-888-999
公司客服网址:www.95679.com
(23) 东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦
法定代表人: 范力
联系人: 方晓丹
电话:0512-65681136
传真:0512-65688021
客服电话:021-73336288
网址:http://www.dwzq.com.cn
(24) 华泰证券股份有限公司
住所:南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人: 吴万善
电话:025-57038523
传真:025-84579763
联系人: 彭长泉
公司网址: www.htsc.com.cn
客户服务热线:95697
(25) 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场46层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
法定代表人: 储晓明
电话:021-33388888或21-54033888
传真:021-54038844
客服电话:95623或4008895623
委托委托:021-962506
网址:www.sywg.com
(26) 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(518048)
法定代表人: 杨宇翔
联系人: 郑舒丽
电话:0755-22626172
客服电话: 95611-8
公司网址: http://www.pingan.com
(27) 中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
法定代表人: 王东明
电话:010-60838888
传真:010-60837339
联系人: 顾凌
客户服务电话:95648
公司网址:www.cs.ecitic.com
(28) 东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
法定代表人: 潘鑫军
联系人: 胡月娟
电话:021-63325888
传真:021-63326729
客户服务热线:95603
公司网站:www.dfzq.com.cn
(29) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
法定代表人: 兰荣
电话:0591-38162212
联系人: 黄英
客户服务热线:95652
公司网站:www.xyzt.com.cn
(30) 中信证券(浙江)有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
法定代表人: 沈强
客户服务电话:95648

公司网址:www.bigsun.com.cn
(31) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16楼至26楼
法定代表人: 何如
联系人: 周杨
电话:0756-82130833
传真:0756-82133962
客户服务电话:95536
国信证券网站:www.guosen.com.cn
(32) 中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层
办公地址: 青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层
法定代表人: 杨宝林
基金业务联系人: 吴忠超
电话:0532-85022326
传真:0532-85022905
客户咨询电话:95548
公司网址:www.citicsd.com
(33) 华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人: 陈琳
邮政编码:200120
客服热线:400-820-9898,021-38929908
总部总机电话:021-68777222
传真:021-68777822
公司网站: http://www.cmhbstock.com
(34) 中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人: 许刚
咨询电话:4006208888或各地营业网点咨询电话
网址:www.bocichina.com
传真:021-50372474
(35) 恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号邮编010010
法定代表人: 庞庆民
联系人: 王旭华
联系电话:0471-4972343
网址:www.cnht.com.cn
(36) 长城证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人: 黄耀华
联系人: 高峰
电话:0755-83516094
传真:0755-83515567
客户服务电话:0755-33680000、400 6666 888
公司网址:www.cgws.com
(37) 渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人: 杜庆平
联系人: 胡彤彤
电话:022-28451709
传真:022-28451968
客户服务电话: 4006515988
网址: http://www.bhzq.com
(38) 中国中投证券有限责任公司
住所:深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座18-21层
法定代表人: 龙增来
联系人: 刘毅
客服电话:400 600 8008,95532
公司网址:www.china-invs.cn
(39) 国元证券股份有限公司
注册地址:合肥寿春路179号
法人代表: 凤良志
客户服务热线:400888777或95678
公司网址:www.gyzq.com.cn
(40) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼
法定代表人: 牛冠兴
联系电话:0755-82568323
传真:0755-82568355
联系人: 余江
客服电话:4008-001-001
公司网址:www.essence.com.cn
(41) 中国国际金融有限公司
住所:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人: 金立群
基金代销业务联系人: 罗春蓉、肖婷
联系电话:010-65051166
传真:010-65058065
(42) 民生证券股份有限公司
注册地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层
法定代表人: 余政
联系人: 赵明
联系电话:010-85127622
联系传真:010-85127917
网址:www.msizq.com
客户服务电话:4006198888
(43) 齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人: 李玮
联系人: 吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网站:www qlzq.com.cn
(44) 华福证券有限责任公司
地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8 层
法定代表人: 黄金琳
客服电话:96326 (福建省外请加拨0591)
公司网址:www.hfzq.com.cn
(45) 信达证券股份有限公司
办公地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院1 号楼信达金融中心
联系人: 唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
(46) 江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人: 孙名扬
联系人: 张青北
电话:0451-85853696
传真:0451-82287211
客户服务热钱:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
(47) 国都证券有限责任公司
注册地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦9 层10 层
法定代表人: 常喆
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
(48) 东兴证券股份有限公司
公司名称:东兴证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人: 徐勇力
基金销售联系人: 汤漫川
电话:010-66555316
传真:010-66555246
公司网站:www.dxzq.net.cn
公司客户服务电话:400-8888-993
(49) 东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人: 杨树财
电话:0431-85096517
传真:0431-85096795
客服电话:4006000686
网站:www.nescn.cn
(50) 德邦证券股份有限公司
住所:上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
注册资本:16.92亿元人民币
法定代表人: 姚文平
联系人: 朱磊
联系电话:862168761616-8507
传真:862168767981
(51) 华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号B1
法定代表人: 李工
公司电话:0551-65161666
传真:0551-65161600
网址:www.haazq.com

客户服务电话: 96518 (安徽) 400-80-96518 (全国)
(52) 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市西藏中路336号
办公地址:上海市西藏中路336号
法定代表人: 龚德雄
联系人: 许曼华
电话:021-53519888
传真:021-53519888
网址:www.962518.com
客户服务电话:4008918918,021-962518
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
公司地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人: 雷杰
全国统一客服热线:95671
方正证券网站:www.foundersc.com
(54) 东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人: 朱科敏
电话:021-20333333
传真:021-50498285
客服电话:95631;400-8888-588
网站:www.longone.com.cn
(55) 中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人: 王宜四
联系人: 戴静
联系电话:0791-86769681
客服电话:400-8866-567
公司网址:www.avicsec.com
(56) 山西证券股份有限公司
注册地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址:山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
联系人: 郭熠
联系电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618,95573
公司网址:www.i618.com.cn
(57) 上海好实基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区南汇118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人: 杨文斌
电话:021-58870011
传真:021-68569919
客服热线:400-786-9665
好实基金交易网:www.ehowbuy.com
(58) 深圳众禄基金销售有限公司
办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单

元
法定代表人: 薛峰
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
客服热线:4006-788-887
公司网址:www.jimwv.com
(59) 杭州数米基金销售有限公司
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
电话:0571-28829790,021-60897869
传真:0571-26698533
客服热线:4000-766-123
公司网址: http://www.fund123.cn/
(60) 上海天天基金销售有限公司
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人: 其实
电话: 021-54509998
传真: 021-64385308
客户服务电话:400-1818-188
公司网址:www.gyza.com.cn
(61) 和讯信息科技有限公司
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人: 王莉
电话: 021-20838789
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
公司网址: licaike.hexun.com
(62) 深圳市新兰德证券咨询服务有限公司
办公地址: 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人: 陈熾
电话: 0755-88394666
传真: 0755-88394677
客户服务电话:400-850-7771
网址: t.jrj.com
(63) 诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人: 汪静波
联系人: 方成
联系电话:021-38609777
公司网址: www.noah-fund.com
客户服务电话: 400-821-5399
(64) 深圳腾元基金销售有限公司
注册地址: 深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼
1806-1810
办公地址: 深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼
1806-1810
法定代表人: 曾革
业务联系人: 陈琳韵
联系电话:0755-33376922
公司网址: www.tenyuanfund.com
客户服务电话: 4006-877-899
(65) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址: 浙江省杭州市文二西路一元元茂大厦903室
法定代表人: 凌顺平
电话:0571-88911818
传真:0571-88910240
网站:www.5ifund.com
客服:4008-773-772
基金管理人可根据有关法律法规的要求选择其他机构代理销售基金,并及时公告。

(二) 注册登记机构: 华宝兴业基金管理有限公司(同上)
(三) 律师事务所和经办律师
名称: 通力律师事务所
住所: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址: 上海市银城中路68号时代金融中心19楼
联系人: 韩炯
电话: (86 21) 3135 8666
传真: (86 21) 3135 8600
联系人: 黎 明
经办律师: 吕红、黎明
(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址: 中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址: 中国上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
执行事务合伙人: 杨绍信
联系电话: (021) 23238888
传真: (021) 23238800
联系人: 俞伟敏
经办注册会计师: 汪棣、俞伟敏
五、基金简介
基金名称: 华宝兴业现金宝货币市场基金
基金类型: 契约型开放式基金
六、基金的投资
(一) 本基金投资目标、对象、理念和策略
1. 投资目标
保持本金的安全性和基金财产的流动性,追求高于比较基准的稳定收益。
2. 投资理念
积极投资,精细管理。在保障基金财产安全的前提下,寻求流动性与收益性的最佳平衡。
3. 投资范围
本基金主要投资于货币市场工具,包括现金、一年以内(含一年)的银行存款、大额存单、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、央行票据、经中国证监会、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。
4. 投资策略
(1) 研究宏观经济指标及利率变动趋势,确定投资组合平均久期。
(2) 在确定投资组合平均久期的条件下,充分考虑相关品种的收益性、流动性、信用等级,确定组合配置。
(3) 利用现代金融分析方法和工具,优化组合配置效果,实现组合增值。
(4) 采用均衡分析、滚动投资、优化期限配置等方法,加强流动性管理。
(5) 实时监控各品种利率变动,捕捉无风险套利机会。
5. 业绩比较基准
同期7天通知存款利率(税后)×(1-利息税率)×当期持有7天通知存款利率
6. 风险-收益特征
本基金属于证券投资基金中高风险、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
(二) 投资程序

1. 公司研究部通过内部独立研究,研究人员根据市场公开披露的信息及专业机构提供的研究报告,对市场利率的预期变动进行分析;跟踪、监测市场上各类金融投资工具的收益率变动,并据此提出投资建议。
2. 在投资决策委员会的指导下,基金经理小组综合对国内外宏观经济、货币政策、货币市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金合同规定,提出下一阶段本基金类属资产配置比例。
3. 投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略,审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。
4. 基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考本公司研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资项目,构建投资组合并负责日常基金管理。
5. 设置集中交易室,基金经理将投资指令下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分隔。
6. 内控审计风险管理部对基金投资过程进行日常监督。
7. 基金经理小组将跟踪货币市场的发展变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量变化情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。
基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。
(三) 投资限制
1. 组合限制
(1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天;
(2) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;
(4) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;
(5) 本基金的基金组合中,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%;
(6) 本基金不得与基金管理人股东进行交易,不得通过交易上的安排为利益相关期限的真实天数;
(7) 本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;
本基金不得投资于以定期票面利率为基准利率的浮动利率债券;
(8) 法律法规或监管部门生效的其他投资比例限制。
本基金将在自基金合同生效之日起不超过6个月内完成建仓。
由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。
2. 禁止行为
本基金禁止从事下列行为:
(1) 违规投资于其他基金;
(2) 从事承担无限责任的投资;
(3) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的债券;
(4) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(5) 承销证券;
(6) 向他人贷款或者提供担保;
(7) 投资于股票;
(8) 投资于可转换债券;
(9) 投资于剩余期限超过397天的债券;
(10) 投资于信用等级在AAA级以下的企业债券;
(11) 中国证监会、中国人民银行禁止从事的其他行为。
(四) 投资组合的平均剩余期限计算方法
1. 投资组合的平均剩余期限计算公式
其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、证券清算款)、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、期限在一年以内(含一年)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、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。
投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购等。

(1) 银行存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限为0天;证券清算款的剩余期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;
(2) 一年以内(含一年)银行定期存款、大额存单的剩余期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算;
(3) 组合中债券的剩余期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外:
允许投资的浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算;
(4) 回购(包括正回购和逆回购)的剩余期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;
(5) 中央银行票据的剩余期限以计算日至中央银行票据到期日的实际剩余天数计算。
七、基金的投资组合报告
本投资组合报告所载数据为截止2014年6月30日(“报告期末”)的数据,本报告中所列财务数据未经审计。
1. 报告期末基金投资组合情况

为, 本基金已为理财产品购买了中国银行理财产品。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,669,034,974.44	38.97
	其中: 债券	2,669,034,974.44	38.97
	资产支持证券	--	--
2	买入返售金融资产	190,900,686.35	2.79
	其中: 买断式回购的买入 返售金融资产	--	--
3	银行存款和清算备付金合计	3,927,265,795.51	57.34
4	其他资产	62,219,443.61	0.91
5	合计	6,849,420,899.91	100.00

2. 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期末债券回购融资余额	2.24	
其中:买断式回购融资	0.00		
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	949,197,513.20	16.24
其中:买断式回购融资	-	-	

注:报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例本报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3. 基金投资组合平均剩余期限
1. 基金投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	110
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

注:报告期内投资组合平均剩余期限超过180天的情况说明
在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

2. 报告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(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	20.60	17.07
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
2	30天(含)-60天	33.50	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	-
3	60天(含)-90天	24.44	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.52	-	
4	90天(含)-180天	6.26	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	
5	180天(含)-397天(含)	31.32	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-	
合计	116.12	17.07	

4. 报告期末按券种和品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,119,060,422.70	19.15
其中:政策性金融债	1,119,060,422.70	19.15	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,549,974,531.74	26.52
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,669,034,974.44	45.66
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	30,444,339.36	0.52

5. 报告期末按摊余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	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130226	13国债26	3,200,000	320.08,785.94
2	041453047	14农发债SCP001	2,000,000	200.05,636.73
3	011490002	14农发债SCP002	2,000,000	200.02,927.30
4	140404	14农发10	1,700,000	170.176,431.07
5	140316	14农发16	1,500,000	148.722,304.04
6	140430	14农发30	1,200,000	120.13,542.96
7	011417004	14农发SCP004	1,200,000	119.953,160.21
8	140204	14国债04	1,000,000	100.00,000.00
9	011490001	14农发SCP001	1,000,000	100.00,123.24
10	041461018	14中电力CP001	1,000,000	100.00,117.03

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%间的次数	0.1480%
报告期内偏离度的最高值	0.0377%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0776%

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资

产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
8. 投资组合报告附注
(1) 基金计价方法说明
本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。
(2) 本报告期内,本基金不存在持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。
(3) 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资法律程序需特别说明。
(4) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	57,986,990.82
4	应收申购款	4,212,388.66
5	其他应收款	20,164.13
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	62,219,443.61

八、基金业绩
本基金业绩数据为截止2014年6月30日(“报告期末”)的数据,本报告期内所列数据未经审计。

本报告期内基金净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较							
阶段	基金级别	基金净值收益率①	基金净值收益率②	比较基准收益率③	比较基准收益率④	①-③	②-④
2005/03/31-2005/12/31	现金类A	1.5336%	0.0024%	1.3611%	0.0000%	0.1919%	0.0024%
	现金类B	1.7372%	0.0024%	1.3611%	0.0000%	0.3761%	0.0024%
2006/01/01-2006/12/31	现金类A	1.7999%	0.0030%	1.8799%	0.0033%	0.1400%	0.0027%
	现金类B	1.9851%	0.0030%	1.8799%	0.0033%	0.1052%	0.0027%
2007/01/01-2007/12/31	现金类A	3.1416%	0.0067%	2.7580%	0.0019%	0.3801%	0.0048%
	现金类B	3.4128%	0.0067%	2.7580%	0.0019%	0.6278%	0.0048%
2008/01/01-2008/12/31	现金类A	3.3103%	0.0057%	2.7576%	0.0032%	0.3757%	0.0025%
	现金类B	3.3865%	0.0057%	2.7576%	0.0032%	0.6299%	0.0025%
2009/01/01-2009/12/31	现金类A	1.1660%	0.0047%	1.3505%	-	0.1446%	0.0047%
	现金类B	1.4064%	0.0047%	1.3505%	0.0000%	0.0560%	0.0047%
2010/01/01-2010/12/31	现金类A	1.6753%	0.0366%	1.5000%	0.0000%	0.3533%	0.0366%
	现金类B	1.9003%	0.0366%	1.5000%	0.0000%	0.5503%	0.0366%
2011/01/01-2011/12/31	现金类A	3.8032%	0.0211%	1.4597%	0.0011%	2.3435%	0.0209%
	现金类B	4.0231%	0.0211%	1.4597%	0.0011%	2.5242%	0.0209%
2012/01/01-2012/12/31	现金类A	4.0458%	0.0379%	1.4199%	0.0022%	2.6605%	0.0355%
	现金类B	4.4444%	0.0379%	1.4199%	0.0022%	2.9505%	0.0355%
2013/01/01-2013/12/31	现金类A	4.0336%	0.0276%	1.5000%	0.0000%	2.7636%	0.0276%
	现金类B	4.5037%	0.0276%	1.5000%	0.0000%	2.9537%	0.0276%
2014/01/01-2014/06/30	现金类A	2.9636%	0.0353%	0.6595%	0.0000%	1.8683%	0.0353%
	现金类B	2.4082%	0.0353%	0.6595%	0.0000%	1.7906%	0.0353%
2005/03/31-2014/06/30	现金类A	24.2851%	0.0515%	16.3767%	0.0020%	13.6635%	0.0031%
	现金类B	32.9610%	0.0515%	16.3767%	0.0020%	16.5843%	0.0031%