天弘增利宝货币市场基金

2014 年度报告摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2015年03月26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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘增利宝货币
基金主代码	000198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月29日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	578,935,761,389.81份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(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		天弘基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	方髓
	联系电话	022-83310208	010-65556899
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	fangwei@citicibank.com
客户服务电话		022-83310988.4007109999	95558
传真		022-83865569	010-65550832

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年
本期已实现收益	24,003,879,023.56	1,789,811,463.60
本期利润	24,003,879,023.56	1,789,811,463.60
本期净值收益率	4.8240%	2.8724%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末
期末基金资产净值	578,935,761,389.81	185,342,015,725.98
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2014年末	2013年末
累计净值收益率	7.8350%	2.8724%

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、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。

3、本基金的利润分配是按日结转份额。

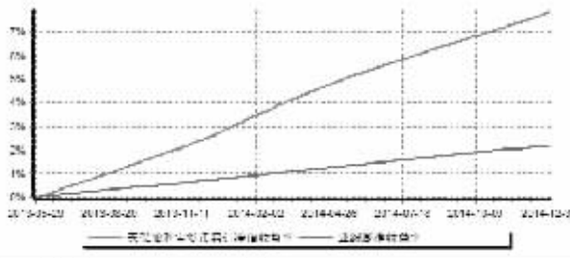
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长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
过去三个月	1.0436%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.6980%	0.0007%
过去六个月	2.0902%	0.0005%	0.6924%	0.0000%	1.3978%	0.0005%
过去一年	4.8240%	0.0022%	1.3781%	0.0000%	3.4459%	0.0022%
自基金合同生效日起至今(2013年5月29日-2014年12月31日)	7.8350%	0.0021%	2.2064%	0.0000%	5.6286%	0.0021%

注:天弘增利宝货币市场基金业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

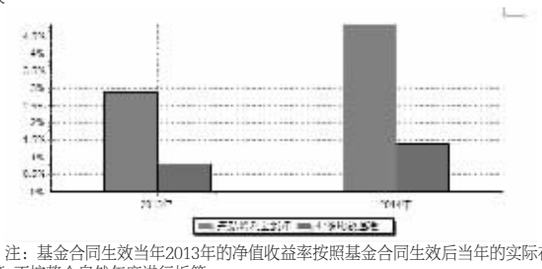
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2013年5月29日生效

2、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:基金合同生效当年2013年的净值收益率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	24,003,879,023.56	-	-	24,003,879,023.56	无
2013年	1,789,811,463.60	-	-	1,789,811,463.60	无
合计	25,793,690,487.16	-	-	25,793,690,487.16	无

§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

天弘基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本公司")经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准,于2004年11月8日正式成立。注册资本金为1.8亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司(持股比例48%)、内蒙古君正能源化工股份有限公司(持股比例36%)、芜湖高新投资有限公司(持股比例16%)。截至2014年12月31日,本基金管理人共管理16只基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘增利宝货币市场基金、 天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、 天弘弘利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王登峰	本基金基金经理、天弘现金管家货币市场基金基金经理、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金经理。	2013年5月	-	5年	男,硕士研究生。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司,历任固定收益研究员。

注:1、上述任职日期分别为基金合同生效日。

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

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定,勤勉尽责地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。

本报告期内,本基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务,依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年,宏观经济受结构调整、房地产周期下行等因素影响,经济增速延续下行态势;货币政策方面,央行为了应对经济下行压力,通过定向宽松的手段向银行体系注入流动性,并适当下调了存贷款利率;资金面方面,由于新股IPO的影响,部分时点资金利率出现较大波动,但整个资金利率中枢较2013年有了明显的下行;债券市场方面,在基本面偏弱,资金面边际改善的情况下,年底之前债券市场全年经历一波较大的牛市行情,年末由于中证登质押比率调整的影响,市场被动去杠杆,造成资金面短期极度紧张,使得债券市场收益率有所回调。

本基金在报告期内,始终把流动性风险管理放在第一位,同时也严格控制组合的信用风险、价格风险和操作风险,确保了报告期内风险事件零发生。根据本基金持有人众多、人均持有量较小的特点,充分利用互联网金融大数据分析的优势,对组合的申购赎回情况,特别是双十一、春节等重大时点进行预测分析,通过资产品种的选择与久期匹配来保障组合的流动性,同时在资金紧张的时点积极布局以提高组合的收益。报告期内,本组合为持有人提供了相对合理的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值收益率4.8240%,同期业绩比较基准收益率1.3781%。

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2015年,经济结构调整依旧较大,房地产投资动力偏弱,经济下行的压力依旧存在;物价方面受国际大宗商品价格的大幅下跌影响,工业品物价仍然有通缩压力,消费品价格也将维持低位。美国经济好转,年内存在加息的可能,近期人民币贬值压力较大,国内有一定的资金流出压力。货币政策方面,为应对经济下行和外汇流出压力,预计央行将采取适度宽松的货币政策。同时,为了应对地方债务问题以及稳增长的需要,财政政策将维持相对积极的基调。资金面方面,受到IPO、季末、节假日等因素资金利率可能有所波动,但资金利率中枢将保持相对稳定。债券市场方面,在经济基本面偏弱的背景下,长期趋势来看依旧较好。

投资策略上,本基金将严格控制流动性风险、信用风险及价格风险,将大数据分析与市场资金面判断有机结合起来,继续为持有人创造持续、稳健、合理的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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,对公司旗下基金已采用的估值政策、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,负责审查批准基金估值政策、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固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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、基金会计、风险管理人员及监察稽核人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,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表决权。

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定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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(该收益参与下一日的收益分配),并按自然日结转至基金份额持有人的基金账户。

§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

本报告期内,作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,尽职尽责地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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了"天保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		490,582,488,639.75	175,541,017,053.14
结算备付金			
存出保证金		-	-
交易性金融资产		46,190,560,822.30	12,762,005,913.59
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		45,369,753,378.68	12,762,005,913.59
资产支持证券投资		820,807,443.62	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		41,156,051,875.07	1,580,737,687.37
应收证券清算款		-	-
应收利息		1,310,474,405.69	492,025,474.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		45,000.00	-
资产总计		579,239,620,742.81	190,375,786,128.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31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		-	4,949,996,640.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		144,299,451.95	39,100,241.16
应付托管费		38,479,853.85	10,426,730.96
应付销售服务费		120,249,543.26	32,583,534.31
应付交易费用		291,503.94	101,301.04
应交税费		-	-
应付利息		-	1,327,955.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		539,000.00	234,000.00
负债合计		303,859,353.00	5,033,770,402.91
所有者权益:			
实收基金		578,935,761,389.81	185,342,015,725.98
未分配利润		-	-
所有者权益合计		578,935,761,389.81	185,342,015,725.98
负债和所有者权益总计		579,239,620,742.81	190,375,786,128.89

注:1、报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额578,935,761,389.81份。

2、本财务报表的比较期间为2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入		27,327,505,810.51	2,013,531,685.24
1.利息收入		27,164,920,431.27	1,995,054,432.43
其中:存款利息收入		25,527,490,109.97	1,867,209,864.11
债券利息收入		1,144,982,665.65	89,214,964.25
资产支持证券利息收入		17,615,985.67	-
买入返售金融资产收入		474,831,669.98	38,629,604.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		162,448,967.22	18,457,002.81
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		454,980.81	-
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)		136,412.02	20,250.00
减:二、费用		3,323,626,786.95	223,720,221.64
1.管理人报酬		1,561,748,533.73	103,857,764.61
2.托管费		416,466,275.65	27,695,403.92
3.销售服务费		1,301,457,111.52	86,548,137.25
4.交易费用		-	20,000.00
5.利息支出		42,890,644.58	5,141,599.34
其中:卖出回购金融资产支出		42,890,644.58	5,141,599.34
6.其他费用		1,064,221.47	457,316.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		24,003,879,023.56	1,789,811,463.60
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		24,003,879,023.56	1,789,811,463.60

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年12月31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)	185,342,015,725.98	-	185,342,015,725.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,003,879,023.56	24,003,879,023.56
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)	393,593,745,663.83	-	393,593,745,663.83
其中:1.基金申购款	3,274,785,766,986.29	-	3,274,785,766,986.29
2.基金赎回款	-2,881,192,021,322.46	-	-2,881,192,021,322.46
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)	-	-24,003,879,023.56	-24,003,879,023.56
五、期末所有者权益(基金净值)	578,935,761,389.81	-	578,935,761,389.81
项目	上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31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)	200,628,721.85	-	200,628,721.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,789,811,463.60	1,789,811,463.60
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)	185,141,387,004.13	-	185,141,387,004.13
其中:1.基金申购款	429,427,181,506.49	-	429,427,181,506.49
2.基金赎回款	-244,285,794,502.36	-	-244,285,794,502.36
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)	-	-1,789,811,463.60	-1,789,811,463.60
五、期末所有者权益(基金净值)	185,342,015,725.98	-	185,342,015,725.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

项目	韩海潮	薄贺龙
	————	————
	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1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的说明

(1)财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》、《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》、《企业会计准则第33号--合并财务报表》以及《企业会计准则第37号--金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号--金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。

上述准则对本基金本报告期及上年度可比期间无重大影响。

(2)本基金本报告期会计报表所采用的会计估计与最近一期年度报告会计报表所采用的会计估计一致。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
北京天地方中资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注:1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,561,748,533.73	103,857,764.61
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	416,466,275.65	27,695,403.92

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

7.4.3.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	1,301,457,111.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	86,548,137.25

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	282,864,578.08	-	-	-	-	-
上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	49,993,664.38	-	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.3.4.2 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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.3.5 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12月31日		上年度可比期间2013年5月29日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	77,682,488,639.75	4,736,214,780.16	26,391,017,053.14	326,115,180.15

注:1. 本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行保管,按银行同业利率计息。

2. 当期利息收入含存放于基金托管人中信银行的协议存款利息收入。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 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	46,190,560,822.30	7.97
	其中:债券	45,369,753,378.68	7.83
	资产支持证券	820,807,443.62	0.14
2	买入返售金融资产	41,156,051,875.07	7.11
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	124,918,607.40	0.02
3	银行存款和结算备付金合计	490,582,488,639.75	84.69
4	其他各项资产	1,310,519,405.69	0.23
5	合计	579,239,620,742.81	100.00

8.2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	0.29
	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	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即可视为交易日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未有超过资产净值20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	天数
报告期未投资组合平均剩余期限	
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过120天的情况。

8.3.2 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	23.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	37.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	14.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	15.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.83	-

8.4 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	27,481,622,276.26	4.75
	其中:政策性金融债	27,481,622,276.26	4.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	17,607,186,523.61	3.04
6	中期票据	280,944,578.81	0.05
7	其他	-	-
8	合计	45,369,753,378.68	7.84
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5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

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	140317	14进出17	45,000,000	4,501,415,784.82	0.78
2	140327	14进出27	44,900,000	4,493,189,467.48	0.78
3	140204	14国开04	27,200,000	2,721,181,547.79	0.47
4	140223	14国开23	23,500,000	2,359,353,380.95	0.41
5	140443	14农发43	21,900,000	2,198,881,524.30	0.38
6	140374	14进出74	20,200,000	1,995,064,606.64	0.34
7	140345	14进出45	15,500,000	1,544,495,786.77	0.27
8	140367	14进出67	14,200,000	1,403,194,839.66	0.24
9	140207	14国开07	8,700,000	871,061,837.42	0.15
10	120219	12国开19	7,000,000	699,077,347.04	0.12

8.6 "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(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0238
报告期内偏离度的最低值	-0.0132
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0064

8.7 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1489060	14开元4A2	4,200,000	420,630,000.00	0.07
2	1489050	14甬银1A1	1,750,000	175,700,000.00	0.03
3	1489155	14开元6A1	1,300,000	129,714,000.00	0.02
4	1489085	14开元5A1	739,000	74,055,190.00	0.01
5	1489144	14交银2A1	220,000	22,017,600.00	0.00

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余