

华夏财富宝货币市场基金

2014 年度报告摘要

全年资金面较为宽松，利率基本处于下行通道。同业存款及短期债券利率均大幅下降，幅度超过150bp。

报告期内，本基金的资产配置上绝大部分为中长期同业存款，并从2季度末开始提升了短期融资券等债券配置比例。在久期控制上，上半年久期保持中性，下半年则基本维持较高久期，有效规避了利率下行的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2014年12月31日，本基金本报告期份额净值收益率为5.0161%，同期业绩比较基准收益率为1.3650%，本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2015年，国内经济增速有继续下行的趋势，且受大宗商品价格持续低迷影响，消费者物价指数(CPI)将持续处于低位，通胀压力很小，通缩压力反而有所增大。央行的货币政策将继续以中性偏宽松为主以支持经济增长。资金方面，资金面仍将以宽松为主，但新股发行因素导致的扰动仍将更为频繁和剧烈，流动性管理的难度和重要性均有所增加。

本基金将继续维持较高仓位的高流动性短期存款投资，做好期限匹配，在保证流动性的前提下争取获得较好的投资收益。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况
本报告期内，基金管理人持续加强合规管理、风险控制 and 监察稽核工作。在合规管理方面，公司修订法律合规工作制度、通信工具管理制度、员工投资行为管理制度、权限管理制度等多项制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；积极参与各项业务的合规性管理，对信息披露文件、各类宣传推介材料进行合规性审查，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司实行全员风险管理，制定出台了风险管理政策、风险管理委员会管理办法、基金流动性风险管理制等各项规章制度，加强风险控制制度建设，特别是投资风险控制，完善控制机制，提高员工的风险管理意识。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究等相关业务和重要岗位进行检查监督，促进公司业务合规开展，稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实筑牢基金安全、合规运作。

4.7 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的规定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所负责估值调整等导致基金资产净值变化的在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数进行适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了保障估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、法律监察工作负责人及基金会计工作负责人等。其中，近三分之二的人员具有10年以上的基金从业经验，且具备风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理制度中的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对于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）等相关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人人，当日收益参与下一日的收益分配，并按日支付且结转为下一日的基金份额。

4.9 报告期内管理人对于本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况说明
本报告期内，本基金托管人在对华夏财富宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理人暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同有关规定，不存在任何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守信用、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内，华夏财富宝货币市场基金的托管人——华夏基金管理有限公司在华夏财富宝货币市场基金的投资运作、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上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理人暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制的华夏财富宝货币市场基金2014年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

5.4 会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师 徐艳 蒋燕华
北京市东长安街1号东方广场东方经贸城亚太大厦16层
2015年3月27日

5.5 托管人报告
本报告期内，本基金托管人在对华夏财富宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理人暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同有关规定，不存在任何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。

5.6 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制的华夏财富宝货币市场基金2014年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

5.7 年度财务报表
会计主体：华夏财富宝货币市场基金
报告截止日：2014年12月31日

5.8 基金净值表现
华夏财富宝货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年10月25日至2014年12月31日)

注：本基金合同于2013年10月25日生效，合同生效当年按实际存续期间计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 自基金合同生效以来基金的利润分配情况
单位：人民币元

4.1 基金管理人及基金基本情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港及深圳设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首批RQFII基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理、香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金以深入的投资研究为基础，积极把握市场机会，尽力为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心基金业绩统计报告，在基金分类排名中（截至2014年12月31日数据），华夏基金“7只主动管理的股票及混合基金今年以来净值增长率超过20%，华夏蓝筹混合（LOF）在43只偏股型基金（股票上限96%）中排名第1，华夏永福养老理财混合在10只偏债型基金中排名第3。固定收益类产品中，华夏基金旗下6只债券型基金今年以来净值增长率超过10%，华夏亚债中国指数在16只指数债券型基金中排名第4。

2014年，在《中国证券报》主办的“第十一届中国基金金鹰奖”评选中，华夏基金荣获年度“金牛基金资产管理公司”，所管理的基金荣获6个单项奖；在《上海证券报》主办的“第十一届中国基金金鹰奖”评选中，华夏基金荣获“基金-TOP公司大奖”，所管理的基金荣获5个单项奖，为获奖最多的基金公司；在《证券时报》主办的“2013年度中国基金金鹰奖”评选中，华夏基金荣获“金牛资产管理公司”、“金牛基金资产管理公司”和“2013年度中国基金金鹰奖”评选中，所管理的基金荣获3个单项奖。

在客户服务方面，2014年，华夏基金继续以客户需求和行为为导向，努力提升客户服务的使用便利性和服务体验：（1）改版电子账单，对投资者账单有结构的合理性给予星级评价，便于客户对账单内容进行合理配置；（2）优化现金红利投资在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额赎回资金实时到账，且可实现即时到账，提高投资者的交易效率；（3）与第三方支付合作推出微理财通服务，支持资金随时购买财富宝货币基金，赎回快速到账，方便投资者进行现金管理。

4.2 基金管理人（或基金经埋团队）及基金经埋团队简介

注：①上任任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
②证券从业的从业资格由行业协会《证券投资基金从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.3 管理人对于报告期内基金管理人遵守法律法规的情况的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》、《基金管理人开展投资、研究活动的内控指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明
4.4.1 公平交易机制和控制方法
本基金管理人根据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和系统手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.4.2 公平交易制度的执行情况
本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人通过抽样检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间下（1日内、3日内、5日内）的年度区间内交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.4.3 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。
报告期内，未出现涉及本基金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运作分析
2014年，国内经济增长压力较大，且通胀持续处于低位，央行全年基本执行了中性偏宽松的货币政策，利率市场化改革、短期流动性调整工具（SLO）及中长期借贷便利（MLF）等创新工具对市场流动性予以支持。除春节前受节假日因素影响及1月中旬之后受新股发行因素扰动导致资金面阶段性紧张外，

注：本基金合同于2013年10月25日生效，上年度可比期间自2013年10月25日至2013年12月31日。
7.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：华夏财富宝货币市场基金
本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

注：本基金合同于2013年10月25日生效，上年度可比期间自2013年10月25日至2013年12月31日。
本报告期于财务报表的组成附注。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：
杨柳青 汪贵华 汪贵华
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 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
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系
与本基金的关系
华夏基金管理有限公司 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） 基金托管人
中信证券股份有限公司 基金管理人、基金托管人的股东
南方工业资产管理有限责任公司 基金管理人、基金托管人的股东
南京农村商业银行 基金管理人、基金托管人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA 基金管理人、基金托管人的股东
青岛瀚朗科技投资有限公司 基金管理人、基金托管人的股东

注：①根据华夏基金管理有限公司于2014年2月12日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信银行（持股比例22%）、山东鲁信农村经济开发投资有限公司（比例10%）、POWER CORPORATION OF CANADA（出资比例10%）、青岛瀚朗科技投资有限公司（出资比例10%）、南方工业资产管理有限责任公司（出资比例7%）、南京农村商业银行（出资比例7%）。
②上述关联方关系均在正常业务范围内进行，均按照公允条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.4.1 股票交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。
7.4.4.1.2 权证交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。
7.4.4.1.3 债券交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。
7.4.4.1.4 债券回购交易
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。
7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金
本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。
7.4.4.2 关联方报酬
7.4.4.2.1 基金管理费

注：①支付基金管理人华夏财富宝货币市场基金的管理费按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。
②基金管理人报酬计算公式为：日基金资产净值×0.27%/当年天数。
7.4.4.2.2 基金销售费

注：①支付基金托管人华夏财富宝货币市场基金的管理费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。
②基金托管费计算公式为：日基金资产净值×0.05%/当年天数。
7.4.4.3 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

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。
7.4.5.2 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需被暂停的暂时停牌股票。
7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
截至本报告期末2014年12月31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4,572,913,460.55元，是如下“债券正回购”为质押：

单位：人民币元

注：本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.6 本基金在报告期内存款和定期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按照银行同业利率或约定利率计息。

7.4.5 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券
7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通