华夏理财30天债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

基金管理人:华夏基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年八月二十五日

§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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华夏理财30天债券	
基金主代码	001057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月24日	
基金管理人	华夏基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,277,918,221.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
下属分级基金的交易代码	001057	001058
报告期末下属分级基金的份额总额	1,179,934,873.11份	97,983,347.96份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求安全性的前提下,追求稳定的绝对回报。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,将投资组合的平均剩余期限控制在150天以内,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于债券型基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔雁巍	田青
	联系电话	400-818-6666	010-67595096
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	010-67595096
传真		010-63136700	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	
	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
本期已实现收益	44,846,859.18	6,157,685.37
本期利润	44,846,859.18	6,157,685.37
本期净值收益率	2.6608%	2.7828%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B
期末基金资产净值	1,179,934,873.11	97,983,347.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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,由于本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本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏理财30天债券A:

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
过去一个月	0.3523%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.2413%	0.0003%
过去三个月	1.1580%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.8214%	0.0008%
过去六个月	2.6608%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	1.9913%	0.0022%
过去一年	5.3666%	0.0022%	1.3500%	0.0000%	4.0166%	0.0022%
自基金合同生效起至今	8.2176%	0.0047%	2.2740%	0.0000%	5.9436%	0.0047%

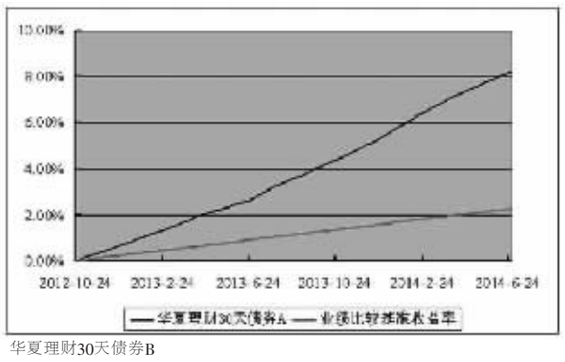
华夏理财30天债券B:

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
过去一个月	0.3722%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.2612%	0.0003%
过去三个月	1.2187%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.8821%	0.0008%
过去六个月	2.7828%	0.0022%	0.6695%	0.0000%	2.1133%	0.0022%
过去一年	5.6178%	0.0022%	1.3500%	0.0000%	4.2678%	0.0022%
自基金合同生效起至今	8.6542%	0.0047%	2.2740%	0.0000%	6.3802%	0.0047%

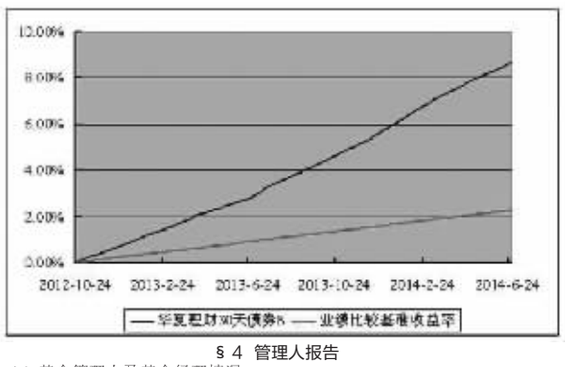
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏理财30天债券型证券投资基金
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
(2012年10月24日至2014年6月30日)

华夏理财30天债券A



华夏理财30天债券B



§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

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、境内首只ETF基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

2014年上半年,在《中国证券报》主办的"第十一届中国基金业金牛奖"评选中,华夏基金荣获年度"金牛基金管理公司奖",所管理的基金荣获6个单项奖;在《上海证券报》主办的"第十一届中国金基金奖"评选中,华夏基金荣获"金基金·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年度中国基金业明星基金奖"评选中,华夏基金荣获"五年持续回报明星基金公司奖"和"2013年度十大明星基金公司奖",所管理的基金荣获3个单项奖。

在客户服务方面,上半年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户资金管理便利性:(1)华夏财富宝货币在微信理财通开通了申购和赎回等业务,方便投资者进行现金管理;(2)华夏现金增利货币在本公司电子交易平台部分支付渠道实现了基金份额变化实时可见,且可见即可用,提高投资者的交易效率;(3)在华夏基金微信公众服务平台增加扫码绑定功能,投资者扫码即可开通基金的微信交易和微信查询,提高投资者使用的便利性。

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		
魏镇江	本基金的基金经理	2013-04-26	-	11年	北京大学经济学硕士。曾任德邦证券债券研究员等。2005年3月加入华夏基金管理有限公司,曾任债券研究员等。

注:①上述任职日期、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。

③根据本基金管理人于2014年8月21日发布的《华夏基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》,聘任罗远航先生为本基金基金经理。

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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、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。

4.3 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,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司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。

4.3.2 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年上半年,国内经济增长疲弱,通胀水平较低。央行执行了中性偏宽松的货币政策,通过公开市场、再贷款和定向降准等方式向市场投放流动性。在此背景下,资金面除春节和季末等时点小有波动外,整体呈现较宽松态势,货币市场利率持续下行,银行间7天回购利率的均值从1季度的4.1%左右下降到2季度的3.3%左右,同业存款利率相比2013年底和春节时的高点也大幅回落。短期债券如短期融资券等受益于资金面宽松有所上涨。

报告期内,本基金主要滚动投资于利率较高的短期同业存款和逆回购,增持了部分短期融资券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,华夏理财30天债券A本报告期份额净值收益率为2.6608%;华夏理财30天债券B本报告期份额净值收益率为2.7828%。同期业绩比较基准收益率为0.6695%,本基金的业绩比较基准为七天通知存款税后利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济增长暂时企稳但仍有压力,通胀水平将比较温和,央行货币政策大幅收紧的可能性较低。外汇占款流入受美联储继续退出量化宽松政策和国外加息预期的影响将有所减缓,公开市场到期资金相比上半年将大幅减少,下半年央行投放资金的渠道将更多依赖再贷款和抵押补充贷款(PSL)等创新方式。货币供应M2增速的反弹将限制央行货币政策进一步宽松的幅度,导致下半年资金面的宽松程度可能不如上半年。

下半年,本基金将增加对短期债券的投资,适当提高组合久期,在控制好流动性风险的前提下力争提高组合收益。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任,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 管理人对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约定,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。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中,本基金管理人为了确保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,组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。其中,近三分之二的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,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。

4.7 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,并在每运作期期末支付且结转为相应的基金份额。

§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,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规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、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方面进行了监督,未发现基金管理人有损害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为51,004,544.55元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华夏理财30天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	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款		912,778,318.91	1,339,697,911.50
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		330,502,730.04	129,542,897.23
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		330,502,730.04	129,542,897.23
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		50,000,195.00	144,500,456.75
应收证券清算款		-	-
应收利息		7,019,630.98	9,896,505.50
应收股利		-	-
应收申购款		883,721.93	32,466,057.81
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,301,184,596.86	1,656,103,828.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30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		19,999,870.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		324,975.78	391,633.81
应付托管费		96,289.10	116,039.62
应付销售服务费		272,787.24	337,878.20
应付交易费用		8,165.09	12,253.20
应交税费		-	-
应付利息		1,735.48	-
应付利润		2,489,086.33	4,314,480.42
递延所得税负债		-	-
其他负债		73,466.77	139,000.00
负债合计		23,266,375.79	5,311,285.25
所有者权益:			
实收基金		1,277,918,221.07	1,650,792,543.54
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,277,918,221.07	1,650,792,543.54
负债和所有者权益总计		1,301,184,596.86	1,656,103,828.79

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,277,918,221.07份(其中A类1,179,934,873.11份,B类97,983,347.96份)。

6.2 利润表

会计主体:华夏理财30天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	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		56,808,926.54	17,380,041.08
1.利息收入		56,822,084.65	16,298,387.97
其中:存款利息收入		51,211,162.99	10,200,326.63
债券利息收入		3,895,275.49	5,100,295.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,715,646.17	997,765.71
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-13,158.11	1,081,653.11
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-13,158.11	1,081,653.11
资产支持证券投资收益		-	-
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)		-	-
减:二、费用		5,804,381.99	3,078,936.86
1.管理人报酬		2,562,146.77	1,006,511.23
2.托管费		759,154.72	298,225.50
3.销售服务费		2,102,794.61	729,179.15
4.交易费用		-	-
5.利息支出		272,479.83	926,940.10
其中:卖出回购金融资产支出		272,479.83	926,940.10
6.其他费用		107,806.06	118,080.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		51,004,544.55	14,301,104.22
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		51,004,544.55	14,301,104.22

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华夏理财30天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	本期 2014年1月1日至2014年6月30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)	1,650,792,543.54	-	1,650,792,543.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,004,544.55	51,004,544.55
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)	-372,874,322.47	-	-372,874,322.47
其中:1.基金申购款	2,420,362,131.15	-	2,420,362,131.15
2.基金赎回款	-2,793,236,453.62	-	-2,793,236,453.62
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)	-	-51,004,544.55	-51,004,544.55
五、期末所有者权益(基金净值)	1,277,918,221.07	-	1,277,918,221.07
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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)	804,651,426.05	-	804,651,426.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,301,104.22	14,301,104.22
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)	-338,935,153.26	-	-338,935,153.26
其中:1.基金申购款	1,290,320,987.95	-	1,290,320,987.95
2.基金赎回款	-1,629,256,141.21	-	-1,629,256,141.21
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)	-	-14,301,104.22	-14,301,104.22
五、期末所有者权益(基金净值)	465,716,272.79	-	465,716,272.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

杨明辉　　崔雁巍　　崔雁巍

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
中信证券(浙江)有限责任公司("中信证券(浙江)")	基金管理人股东控股的公司、基金销售机构

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证券(出资比例62.2%)、山东省农村经济开发投资公司(比例10%)、POWER CORPORATION OF CANADA(出资比例10%)、青岛海鹏科技投资有限公司(出资比例10%)、南方工业资产管理有限责任公司(出资比例7.8%)。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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。

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 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。

6.4.4.1.4 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。

6.4.4.1.5 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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,562,146.77	1,006,511.23
其中:支付销售机构的客户维护费	362,998.40	241,579.71

注:①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	759,154.72	298,225.50

注:①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

6.4.4.2.3 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6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B	合计
华夏基金管理有限公司	1,132,732.91	4,032.68	1,136,765.59
中国建设银行	370,006.68	1,533.53	371,540.21
中信证券	2,303.29	-	2,303.29
中信证券(浙江)	795.71	-	795.71
合计	1,505,838.59	5,566.21	1,511,404.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华夏理财30天债券A	华夏理财30天债券B	合计
华夏基金管理有限公司	179,035.02	4,467.23	183,502.25
中国建设银行	317,563.43	952.83	318,516.26
中信证券	8.24	-	8.24
合计	496,606.69	5,420.06	502,026.75

注:①支付基金销售机构的基金销售服务费分别按A类、B类基金份额前一日基金资产净值0.25%、0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人,再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为:A类日基金销售服务费=前一日A类基金资产净值×0.25%/当年天数;B类日基金销售服务费=前一日B类基金资产净值×0.01%/当年天数。

6.4.4.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日					
	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
中国建设银行	20,262,598.08	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30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
中国建设银行	-	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.4.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.4.5 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6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	778,318.91	5,261.88	2,628,403.12	9,175.92
中国建设银行定期存款	-	4,393,055.56	-	-

注:本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.4.6 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均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.5 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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披露的暂时停牌股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30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19,999,870.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
140207	14国开07	2014-07-01	100.35	200,000	20,069,850.03
合计	-	-	-	200,000	20,069,850.03

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定,以公允价值计量的金融工具,其公允价值的计量可分为三个层级:

第一层级:对存在活跃市场报价的金融工具,可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层级:对估值日活跃市场无报价的金融工具,可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值;对估值日不存在活跃市场的金融工具,可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层级:对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具,可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.6.2各层级金融工具公允价值

截至2014年6月30日止,本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层级的余额为0元,第二层级的余额为330,502,730.04元,第三层级的余额为0元。(截至2013年12月31日止:第一层级的余额为0元,第二层级的余额为129,542,897.23元,第三层级的余额为0元。)

6.4.6.3公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

6.4.6.4第三层级公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层级公允价值本期未发生变动。

§7 投资组合报告

7.1 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	330,502,730.04	25.40
	其中:债券	330,502,730.04	25.40
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,195.00	3.84
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	912,778,318.91	70.15
4	其他各项资产	7,903,352.91	0.61
5	合计	1,301,184,596.86	100.00

7.2 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	0.87	
	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	19,999,870.00	1.57
	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的比例为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的40%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	22

报告期内投资组合平均剩余期限超过150天情况说明

本基金合同约定:"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150天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

7.3.2 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	26.20	1.57
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	18.77	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	19.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	合计	101.20	1.57

7.4 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	100,130,845.23	7.84
	其中:政策性金融债	100,130,845.23	7.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	230,371,884.81	18.03
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	330,502,730.04	25.86
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	140207	14国开07	400,000	40,139,700.06	3.14
2	041460014	14鲁商CP001	300,000	30,158,577.24	2.36
3	041451010	14浙物产CP001	300,000	30,153,757.37	2.36
4	041462005	14天药集CP001	300,000	30,091,287.03	2.35
5	011437006	14中建材SCP006	300,000	30,052,354.76	2.35
6	041458049	14中铝业CP003	300,000	30,000,148.01	2.35
7	071415005	14中万CP005	300,000	29,995,324.96	2.35
8	110413	11农发13	200,000	20,009,640.28	1.57
9	130227	13国开27	200,000	19,998,728.00	1.56
10	130243	13国开43	200,000	19,982,776.89	1.56

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(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.05%
报告期内偏离度的最低值	0.01%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.03%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投