



华夏现金增利证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

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×0.10%/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
华夏基金管理有限公司	33,363,510.04
中国建设银行	16,259,481.96
中信证券	433,618.60
中信证券(浙江)	—
中信证券(山东)	219,508.85
合计	50,642,398.57
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
华夏基金管理有限公司	18,299,510.15
中国建设银行	8,174,931.92
中信证券	325,136.78
合计	26,799,578.85

注:①支付基金销售机构的基金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,按月支付给基金管理人,再由基金管理人支付给各基金销售机构。
②基金销售服务费计算公式为:日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/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

		本期 2014年1月1日至2014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		基金赎回		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	-	-	-	-	9,167,000,000.00	7,061,443.12	
		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		基金赎回		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	473,253,060.00	152,901,539.72	-	-	3,779,200,000.00	2,483,215.89	

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 报告期未除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期未及上年度均未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

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 报告期未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

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
中国建设银行活期存款	155,480,706.65	161,995.53
中国建设银行定期存款	13,300,000,000.00	408,144,444.34
合计	13,455,480,706.65	408,306,140.87

注:本基金的活期银行存款和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

关联方名称		证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量 单位:股/张	总金额
中信证券		011433006	14广石SCP006	新债发行	2,000,000	199,850,000.00
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日						
关联方名称		证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量 单位:股/张	总金额
中信证券		-	-	-	-	-

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有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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13,299,199,574.97元,具体如下表作为质押:

14,329,199,574.97元,是以加“国债”作为质押;

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确定公允价值。

第三层级:对无法获得相同或类似资产/负债市场价格的金融工具,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 金融资产公允价值估值

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16,047,023,588.85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8,695,228,708.26元,第三层级的余额为0元。)

6.4.6.3 公允价值所属层级的重大变动

本基金截至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. 期末基金资产组合情况

140430	14级宏发30	2014-07-07	100.06	5,000,000	500,320,444.80
14043001	14级宏发30CP03	2014-07-07	3.44	168,000	24,290,299.20
14045809	14广中电业CP03	2014-07-07	100.00	2,551,000	255,100,000.00
04150027	14广中电业CP01	2014-07-07	100.00	2,000,000	200,000,000.00
01183306	14五矿SCP06	2014-07-07	99.93	2,000,000	199,856,737.89
04166038	14津地铁CP01	2014-07-07	100.00	1,948,000	194,800,267.17
01120066	14中铝SCP06	2014-07-07	100.23	1,600,000	160,365,988.80
01120005	14中铝SCP03	2014-07-07	100.26	1,500,000	150,394,313.21
01149501	14中石化SCP01	2014-07-07	99.93	1,500,000	149,889,852.38
1282607	12广建MTN1	2014-07-07	99.99	1,200,000	119,991,512.01
04162099	14津地铁CP02	2014-07-07	100.77	800,000	80,218,648.62
04156003	14广中电业CP01	2014-07-07	100.00	800,000	80,000,000.00
04153666	14赣铜SCP01	2014-07-07	100.45	700,000	70,330,760.06
04162001	14中铝SCP01	2014-07-07	101.17	626,000	63,312,290.02
04166037	14烟台CP01	2014-07-07	100.31	600,000	60,186,902.82
04136407	13青岛国信CP02	2014-07-07	101.42	500,000	50,711,893.31
04158027	14广中电业CP01	2014-07-07	100.38	500,000	50,189,088.96
01141503	14中铝SCP03	2014-07-07	100.29	500,000	50,146,950.97
04172006	14年巨发金债CP01	2014-07-07	100.22	500,000	50,108,437.20
01143706	14广中电业CP06	2014-07-07	101.17	500,000	50,087,166.46
990801	09广中电业CP01	2014-07-07	100.00	400,000	39,329,168.00
04154005	14中铝SCP01	2014-07-07	100.84	300,000	30,252,140.73
04156014	14广中电业CP02	2014-07-07	100.71	300,000	30,213,651.73
04162640	13广土万发债CP02	2014-07-07	100.00	100,000	10,000,052.72
合计	-	-	-	48,364,000	14,753,788,732.71

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		84,523,407,789.98	36,650,960,574.49
结算备付金		--	--
存出保证金		--	--
交易性金融资产		16,047,023,568.88	8,695,228,708.28
其中:股票投资		--	--
基金投资		--	--
债券投资		15,797,023,568.88	8,695,228,708.28
资产支持证券投资		250,000,000.00	--
衍生金融资产		--	--
买入返售金融资产		693,501,120.00	2,999,801,200.00
应收证券清算款		--	--
应收利息		357,037,619.09	510,432,175.05
应收股利		--	--
应收申购款		564,097,981.18	650,447,952.46
递延所得税资产		--	--
其他资产		--	--
资产总计		102,185,068,079.13	49,506,870,610.28

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		14,329,199,574.97	5,733,750,842.61
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		31,192,035.24	14,075,849.82
应付托管费		9,452,131.95	4,265,409.05
应付销售服务费		23,603,329.73	10,663,522.55
应付交易费用		187,491.53	175,441.93
应交税费		301,852.46	301,852.46
应付利息		5,159,874.68	2,279,122.60
应付股利		11,072,770.30	6,653,864.80
递延所得税负债		—	—
其他负债		192,527.05	379,047.35
负债合计		14,410,388,587.91	5,772,544,953.17
所有者权益:			
实收基金		87,774,679,491.22	43,734,325,657.11
未分配利润		87,774,679,491.22	43,734,325,657.11
所有者权益合计		87,774,679,491.22	43,734,325,657.11
负债和所有者权益总计		102,185,068,079.13	49,506,870,610.28

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0.10%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,再由基金管理人支付给各基金托管人。
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×0.10%/当年天数。

6.2 利润分配

6.2.1 利润分配:华夏现金增利证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	附注号	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		2,775,361,885.98	1,188,468,474.17
1.利息收入		2,754,686,018.82	1,176,406,083.90
其中:存款利息收入		2,424,562,024.99	835,833,296.46
债券利息收入		310,741,200.19	325,796,617.58
资产支持证券利息收入		174,266.98	-
买入返售金融资产收入		19,208,547.12	14,774,169.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		20,675,654.66	12,059,938.47
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		20,675,654.66	12,059,938.47
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)		212.50	2,451.80
减:二、费用		414,350,651.04	256,184,256.25
1.管理人报酬		154,362,915.97	80,919,523.67
2.托管费		46,776,641.22	24,521,067.80
3.销售服务费		116,941,602.99	61,202,669.52
4.交易费用		-	-
5.利息支出		96,009,742.29	89,308,256.94
其中:卖出回购金融资产支出		96,009,742.29	89,308,256.94
6.其他费用		259,748.77	232,738.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,361,011,234.94	932,284,217.92
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,361,011,234.94	932,284,217.92