

基金管理人:诺安基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司 送出日期:2014年8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

基金托管人中国工商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

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

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 § 2 基金简介

2.1 基金基本情况		
基金简称	诺安稳固收益一年定期开放债券	
基金主代码	000235	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年8月21日	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,492,597,264.38 份	
サム人目左体物	で空間	

基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下,力求资产持续稳妥 地保值增值,为投资者提供较好的养老资产管理工具。
投资策略	1.封闭即投资策略 在封闭即人,会全理控制本基金开放期的流动性风险,并满足每 次开放期的流动性需求。原则上本基金在投资管理中将持有债券的 组合、如用与封闭即进行适当的匹配。即由了在遵守本基金有关投资 限制与投资性例的前接下,将主要投资干汤流动性的投资品种。流分基金单值的成功。 2.升泛射投资安排 在开放期,基金管理人将采取各种有效管理措施。保障基金运作 安排、防污流动性风险。洞边开放期流动性的需求。在开放期前根据 市场情况、进行相压压力测试、制定开放期操作规论流程和应急预 案。做好应付极知情态工产和概则
业绩比较基准	本基金的业绩社校基准为、固定业绩基准30%、该业绩基准适用于考基金第一个封闭期,其他封闭期的业绩基准由管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		1	基金管理人	基金托管人	
名称 诺安基金		诺安基金管理	里有限公司	中国工商银行股份有限公司	
	姓名	陈勇		赵会军	
信息披露负责人	联系电话	0755-830266	88	010-66105799	
	电子邮箱	info@lionfund.	.com.cn	custody@icbc.com.cn	
客户服务电话 400-888-89		400-888-899	8	95588	
传真 0755-830266		77	010-66105798		
2.4 信息披露	露方式				
本基金选定的信息披露报纸名称		(中国证券	\$报》、《上海证券报》、《正券时报》		

市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基命管理

基金半年度报告备置地。 § 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	63,489,494.06
本期利润	110,936,021.64
加权平均基金份额本期利润	0.0445
本期基金份额净值增长率	4.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0411
期末基金资产净值	2,637,970,727.86
期末基金份额净值	1.058

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。 ③ 期末可供分配利润是采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰

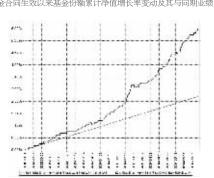
低数。 3.2 基金净值表现

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	份额净值增长 率①	份额净值增长 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	0.67%	0.05%	0.25%	0.01%	0.42%	0.04%
过去三个月	2.42%	0.05%	0.73%	0.01%	1.69%	0.04%
过去六个月	4.34%	0.05%	1.47%	0.01%	2.87%	0.04%
自基金合同生效 起至今	5.80%	0.05%	2.58%	0.01%	3.22%	0.04%

期,其他封闭期的业绩基准由管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布。

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



②本基金的建仓期为 2013 年 8 月 21 日至 2014 年 2 月 20 日,建仓期结束时各项资产配 置比例符合基金合同约定。

§ 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 截至 2014年 6月,本基金管理人共管理 34 只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安 货币市场基金、诺安股票证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增 利债券型证券投资基金、诺安中证 100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选股票型证券投资 基金、诺安主题精选股票型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺 安保本混合型证券投资基金、诺安多策略股票型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投 资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基 金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利 债券型发起式证券投资基金,中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金,诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金,诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金,诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金,诺安稳 固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、 诺安天天宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金及诺安理财宝货 币市场基金

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 (助理)期限		证券从业年	说明	
X±45	8/C95	任职日期	离任日期	限	10097	
谢志华	诺放便法 经基本 经基本 经工程 计算量 经 计 计 经 计 经 计 经 计 经 计 经 计 经 计 经 计 经 计	2013年8月21日	-	8	理学師上、具有基金人以收款係、曾先后 任职于生等证券有限责任公司,招商 基金管理有限公司,从事固定收益等。 总种的研究、投资工作。曾节2010年8 月至 2012年8月任招商安心收益债 專型证券投资基金基金经理,2011年 3月至 2012年8月任招商安市遗址或债 多月加入诺安基金管理有限公司,任保 多月加入诺安基金管理有限公司,任保 多月加入诺安基金管理有限公司,任保 使完整理。2013年6月起任诺安信息, 理。2013年6月起任诺安信息, 理。2013年6月起任诺安信息, 理。2013年6月起任诺安信息, 是一个企业,是一个企业, 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	

注:①此处基金经理的任职日期为基金合同生效之日; 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》的相关规定等。 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金管理人严格遵守了《中华人 民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安稳固收益一年定期开放债券型 证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行

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

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公 司更新并完善了《诸安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场中购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、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

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标,投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和 交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合 经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研

究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。 交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易 中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证 券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每 笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购 等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数 量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配, 如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交 易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资 指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原

诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30日

则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明 本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合 参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量 的 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 经过 2013 年的大幅调整,债券市场在 2014 上半年走出了一波牛市行情。一季度以短端 收益率下行较多的陡峭化下行为主,而二季度则为长端收益率下行的陡峭化下行为主。对经济增速超预期下行的担忧和 "定向降准"的出台,坚定了投资者对货币市场持续宽松的预期,为债券市场行情发展提供了良好环境。二季度末、经济数据企稳修复了投资者对经济过于

悲观的预期,债券市场短暂调整,收益率窄幅震荡。

投资运作上,诺安稳固的投资以信用债为主,上半年在宽松的融资环境中,加大了组合的 杠杆比例,券种配置方面,基于组合的投资周期,短期品种配置较多。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.058元。本报告期基金份额净值增长率为4.34%,同

期业绩比较基准收益率为 1.47%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济短期企稳,货币政策环比大幅放松的可能性降低,在外汇占款减少的情况下,预计央行将继续结合再贷款、PSL 和国库现金定存等工具维持合理的基础货币投放,保持市场 合理的流动性。展望三季度,政策微刺激的力度和影响值得关注,央行公开市场操作对短端利 率的定位、债券供给扩容节奏也是影响债券市场的重要因素。我们将密切关注各方面因素的 变化,努力把握投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》 以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及 份额争值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额争 值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、

年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。 报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽 核部和风险控制部、固定收益部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。 估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格,专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介人基金日常估值业 务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案 但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值

报告期内,本基金未签约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

在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分 配比例不得低于该次可供分配利润的50%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。 本报告期内,本基金未进行利润分配,符合合同约定。

§ 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,本基金托管人在对诺安稳固收益债券基金证券投资基金的托管过程中,严 格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,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规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 本报告期内,诺安稳固收益债券基金证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司 在诺安稳固收益债券基金证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回 价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方 面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,诺安稳固收益债券基金证券投资基金 未进行利润分配。

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 本托管人依法对诸安基金管理有限公司编制和披露的诺安稳固收益债券基金证券投资 基金 2014 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告 等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金 报告截止日,2014年6月30日

资产	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	7,691,014.49	380,655,580.93
结算备付金	310,351.38	31,941,428.57
存出保证金	-	31,480.1
交易性金融资产	3,493,374,000.00	1,836,837,000.00
其中:股票投资	-	
基金投资	-	
债券投资	3,493,374,000.00	1,836,837,000.0
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	_	
衍生金融资产	_	
买人返售金融资产	_	260,000,000.0
应收证券清算款	_	153,849.2
应收利息	87,791,038.91	18,958,633.6
应收股利	_	
应收申购款	_	
递延所得税资产	_	
其他资产	_	
资产总计	3,589,166,404.78	2,528,577,972.6
负债和所有者权益	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	949,268,116.84	
应付证券清算款	85,784.19	
应付赎回款	_	
应付管理人报酬	-	
应付托管费	388,913.36	385,690.1
应付销售服务费	1,080,314.90	1,071,361.3
应付交易费用	25,527.35	26,214.9
应交税费	-	
应付利息	158,581.18	
应付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	188,439.10	60,000.0
负债合计	951,195,676.92	1,543,266.3
所有者权益:		
实收基金	2,492,597,264.38	2,492,597,264.3
未分配利润	145,373,463.48	34,437,441.8
所有者权益合计	2,637,970,727.86	2,527,034,706.2
负债和所有者权益总计	3,589,166,404.78	2,528,577,972.6

项目

会计主体:诺安稳固收益一年定期开放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

本期 2014年1月1日至2014年6月30日 (返售金融资) 3,460,361.78 设资收益(损失以""填列) 1,746,992.47 1,746,992.47 47,446,527.58 汇兑收益 假失1 14,874,481.36 2,301,729.30 10,845.00 5,958,986.13 5,958,986.13 209.228.44 110,936,021.64

注:报告截止日 2014 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.058 元,基金份额总额 2,492,597,264.38

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:诺安稳固收益一年定期开放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

本期 2014年1月1日至2014年6月30日 期初所有者权益 (基金 2,492,597,264.3 2,527,034,706.22 110,936,021.64 净值变动数 (净值减少以""号填列 中:1.基金申购款

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:

奥成文 薛有为 薛有为 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 重要会计政策和会计估计

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报告一致。 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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 本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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

注:下述关联方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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内不存在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

本基金管理费采用的浮动费率方式如下:

(1)本基金不收取固定管理费,以分档计提方式收取浮动管理费;

(2)本基金的业绩比较基准为:固定业绩基准 3.0%,该业绩基准适用于本基金第一个封 闭期,其他封闭期的业绩基准由管理人和托管人协商一致后在开放期另行公布;

(3) 封闭运作一年之后,基金管理人将以封闭期基金净值增长率为基础分档收取管理 在分档模式下,基金管理人将封闭期基金净值增长率由低到高划分为四档并设定不同等 级的管理费率。封闭期基金净值增长率越大的档,管理费率越高(具体档数、不同档数封闭期 基金净值增长率起止点、不同档数管理费率如下表)。管理费在管理费计提日计提,并将对应 四档管理费计提日基金份额净值。同时,管理费的提取将保证高档数的管理费计提日基金份 额净值不低于低档数的管理费计提日基金份额净值。 基金管理费分档费率表

设 N 为封闭期基金净值增长率:

[档数	封闭期基金净值增长率 (N)	管理费率
	1	N≤4.0%	0%
	2	4.0% <n≤5.5%< td=""><td>0.3%</td></n≤5.5%<>	0.3%
	3	5.5% <n≤7%< td=""><td>0.7%</td></n≤7%<>	0.7%
	4	7% <n< td=""><td>1.0%</td></n<>	1.0%
,	其全管理费以封闭期最后—日	日	理费计提口约

束后由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于管理费计提 日结束后 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

单位:人民币元

项目	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托管费		2,301,729.30
注: 本基金的托管费按前一日	基金资产净值的 0.18%年费率计提。	托管费的计算方法如

H=E×0.18%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送 基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。 若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.4.2.3 销售服务费

	单位:人民币元
获得销售服务费 各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
台大联刀石桥	当期发生的基金应支付的销售服务费
诺安基金管理有限公司(管理人)	859,628.93
中国工商银行股份有限公司(托管人)	2,934,083.23
合计	3,793,712.16
注: 本基金的销售服务费年费率为	0.50%。本基金销售服务费按前一日基金资产净值的

0.50%年费率计提。销售服务费额计算方法如下: M=E×0.50%÷当年天数

M 为每日应计提的销售服务费

E为前一日基金资产净值 基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人

发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次 性支取,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。 若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。 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

					1	単位:人民市刀
本期 2014年 1 月 1 日至 2014年 6 月 30 日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公 司	-	-	-	-	42,750,000.00	2,459.59
A A A A A A A A A A A A A A A A A A A						

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 本报告期内基金管理人无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 本报告期末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	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日				
名称	期末余额	当期利息收入			
中国工商银行 股份有限公司	7,691,014.49	34,711.83			
注:本基	金的银行存款由基金托管人中国工商银	限行股份有限公司保管,按适用利率或:			

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止,本基金无因认购新发 / 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

单位:人民币元

110,936,021.64

单位:人民币元

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。 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 出回购证券款余额人民币 599,268,116.84 元,是以如下债券作为质押:

041352040 13建发 CP001 2014年 7 月 1 50,455,000.00 041353080 13宁交建 CP001 2014年 7 月 1 13杉杉 CP002 2014年 7 月 1 300.000 30,249,000.00 13钱江水利 CP001 2014年 7 2014年7月 200,000 20.258,000.00 15,142,500.00 13锡产业 CP002 2014年 7 月 1 250,000 25.342.500.00 130229 13国开 29 2014年 7 月 1 500,000 2014年7月1 13国开 38 1,000,000 99,330,000.00 200,000 20,794,000.0 13黑牡丹 CP001 30,363,000.0 300,000 041359075 13巨石 CP002 2014年 7 月 14 日 500,000 50,545,000.00 50,700,000.0 041360069 13合工投 CP001 2014年 7 月 14 日

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖 出回购证券款余额 350,000,000.00 元,于 2014 年 7 月 1 日及 2014 年 7 月 7 日 (先后)到期。该 类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转人 质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(2)以公允价值计量的金融工具 ①金融工具公允价值计量的方法

于2014年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额 为 40,400,000.00 元,属于第二层级的余额为 3,452,974,000.00 元,无属于第三层级的余额(于 2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 1,

836,837,000.00元,无属于第一层级和第三层级的余额。)。 ③公允价值所属层级间的重大变动

行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关 股票和债券的公允价值列人第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允 价值列入第一层级,

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

2. 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	3,493,374,000.00	97.33
	其中:债券	3,493,374,000.00	97.33
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,001,365.87	0.22
7	其他各项资产	87,791,038.91	2.45
8	合计	3,589,166,404.78	100.00
7.2	! 期末按行业分类的股票投资组合		

本基金本报告期末未持有股票。 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 本基金本报告期内未持有股票。 7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)		
1	国家债券	-	_		
2	央行票据	-	_		
3	金融债券	168,884,000.00	6.40		
	其中:政策性金融债	168,884,000.00	6.40		
4	企业债券	751,001,000.00	28.47		
5	企业短期融资券	1,926,851,000.00	73.04		
6	中期票据	646,638,000.00	24.51		
7	可转债	-	_		
8	其他	-	-		
9	合计	3,493,374,000.00	132.43		
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细					

全麵单位, 人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比 例 %)
1	130238	13国开 38	1,000,000	99,330,000.00	3.77
2	1380367	13邯郸城投债	500,000	52,670,000.00	2.00
3	1380373	13宁德国投债	500,000	52,460,000.00	1.99
4	101364012	13泰交通 MTN001	500,000	52,015,000.00	1.97
5	101459003	14嘉实投 MTN001	500,000	51,465,000.00	1.95

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资明细本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

7.10.1 本期国债期货投资政策 本基金本报告期未投资国债期货

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。 7.11 投资组合报告附注 7.11.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本报告期没有出现被监管部门立

案调查的情形,也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

7.11.2 本基金本报告期投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的股票 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元 3 应收股利 87,791,038.9

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末未持有股票。 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五人原因,分项之和与合计可能有尾差 § 8 基金份额持有人信息 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

163,470.44

份额单位:份 持有份额

335,004,375.00 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 本基金本报告期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人 有本开放式基金 § 9 开放式基金份额变动 单位:份 基金合同生效日 (2013年8月21日)基金份额总额 2,492,597,264.38 2,492,597,264.3

持有基金份额总量的数量区间 (万

§ 10 重大事件揭示 10.1 基金份额持有人大会决议 告期内未召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

是新内、基金管理人无重大人事变动。 本据告期内、IB中国工商银行股份有限公司(以下简称、本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经 本据告期内、IB中国工商银行股份有限公司(以下简称、本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理主立凌严 七多行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项 10.4 基金投资策略的改变 本报告期内,基金的投资组合策略没有重大 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 10.7 其全和用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况 金额单位:人民币元								ċ
١			股票交易		应支付该券商的佣金			l
	券商名称	交易单元数 量	成交金額	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注	
	切害证券	1						ı

注:1、本报告期租用证券公司的交易单元变更情况:无。

2、专用交易单元的选择标准和程序 基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

(1) 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于 3 亿元人民币 (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定

(3) 经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。 (4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。 (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易 的需要,并能为本基金提供全面的信息服务

(6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的 基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订

《专用证券交易单元租用协议》。 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元 券商名称 成交金额 成交金额

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 \$\$\$\$(5) 平足州开放场处。自个封村斯城東之后第一个工作日間 2014 年 8 月 21 日为基金管理教计提日 - 办理基 蚌埠、城田业务、第二个工作日建进入省个开放服,时间为2014年 8 月 22 日至 2014年 9 月 17 日,开放铜内本基金 蚌埠、城田业务申请。自 2014年 9 月 18 日起至一年后对应日的前一日 2015年 9 月 17日 1分本基金的第二个封闭第 报酬大基金布经专用版 建阳业年档

2014年8月26日

110,936,021.64 2,492,597,264.38 145,373,463.48 2,637,970,727.8

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

1.公允价值 (1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意 义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。 ②各层级金融工具公允价值

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发

投资者对本报告书如有疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务电话: 400-888-8998, 亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。 诺安基金管理有限公司