诺安货币市场基金

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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
送出日期:2014年8月26日

§1 重要提示

1.1 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。

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	诺安货币	
基金主代码	320002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年12月6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	4,968,590,783.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	诺安货币A	诺安货币B
下属分级基金的交易代码:	320002	320019
报告期末下属分级基金的份额总额	636,694,060.62份	4,331,896,723.15份

2.2 基金产品说明

投资目标	确保本金的安全性和资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益。
投资策略	根据宏观经济、央行货币政策操作及短期资金市场供求情况,判断短期利率的走势,进行自上而下的整体资产策略配置和资产组合配置,同时,根据定量和定性方法,在个别回购品种、债券品种和市场时机方面进行主动式选择。
业绩比较基准	以当期银行个人活期储蓄利率(税后)作为衡量本基金操作水平的比较基准。
风险收益特征	本基金流动性高,风险低并且收益稳定。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	赵会军
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	010-66105798

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.lionfund.com.cn
基金半年度报告报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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

基金级别	诺安货币A	诺安货币B
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)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	19,480,230.34	67,459,660.85
本期利润	19,480,230.34	67,459,660.85
本期净值收益率	2.1278%	2.2501%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	636,694,060.62	4,331,896,723.15
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:① 本基金的利润分配方式是“每日分配,按月支付”。

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 自2012年2月21日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,详情请参阅相关公告。

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

诺安货币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	0.2988%	0.0043%	0.0292%	0.0000%	0.2696%	0.0043%
过去三个月	0.9607%	0.0033%	0.0885%	0.0000%	0.8722%	0.0033%
过去六个月	2.1278%	0.0040%	0.1760%	0.0000%	1.9518%	0.0040%
过去一年	4.1000%	0.0039%	0.3549%	0.0000%	3.7451%	0.0039%
过去三年	12.1773%	0.0039%	1.2124%	0.0002%	10.9649%	0.0037%
自基金合同生效起至今	30.6648%	0.0052%	4.6547%	0.0004%	26.0101%	0.0048%

诺安货币B

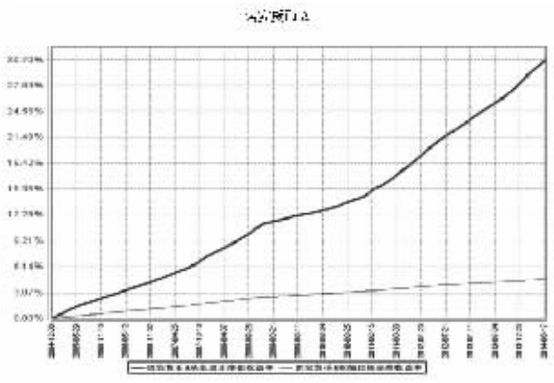
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3184%	0.0043%	0.0292%	0.0000%	0.2892%	0.0043%
过去三个月	1.0215%	0.0033%	0.0885%	0.0000%	0.9330%	0.0033%
过去六个月	2.2501%	0.0040%	0.1760%	0.0000%	2.0741%	0.0040%
过去一年	4.3499%	0.0039%	0.3549%	0.0000%	3.9950%	0.0039%
自基金合同生效起至今	9.8099%	0.0040%	0.8860%	0.0001%	8.9239%	0.0039%

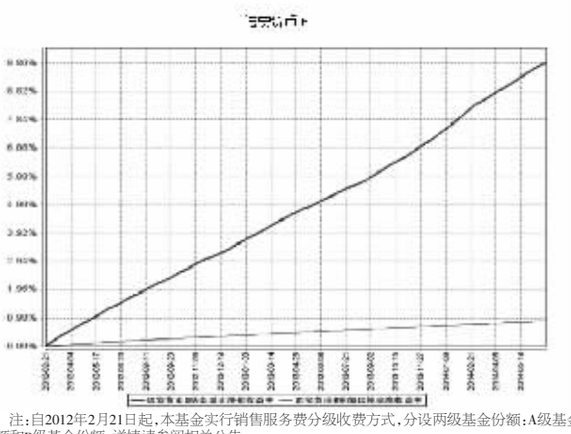
注:①本基金的利润分配方式是“每日分配,按月支付”。

② 本基金的业绩比较基准为:当期银行个人活期储蓄利率(税后)。

③自2012年2月21日起,本基金分设为两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额;其中B级基金份额的指标计算自分级实施日(2012年2月21日)算起。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





注:自2012年2月21日起,本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,详情请参阅相关公告。

§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联接基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鑫保本混合型证券投资基金、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、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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张乐赛	固定收益部总监、诺安货币市场基金基金经理、诺安保本混合型证券投资基金基金经理、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理、诺安天天银货币市场基金基金经理、诺安理财宝货币市场基金基金经理	2006年8月19日	-	9	硕士,具有基金从业资格。曾就职于南京商业银行资金运营中心;2004年12月加入诺安基金管理有限公司,现任固定收益部总监。曾于2009年8月至2012年1月担任诺安优化收益债券型证券投资基金的基金经理。2006年8月起担任诺安货币市场基金的基金经理,2011年5月起担任诺安保本混合型证券投资基金的基金经理,2012年5月起担任诺安汇鑫保本混合型证券投资基金的基金经理。2014年3月起担任诺安天天宝货币市场基金基金经理,2014年5月起担任诺安理财宝货币市场基金基金经理。
王玥晰	诺安货币市场基金基金经理	2013年7月31日	-	5	理学硕士,具有基金从业资格。2008年11月加入诺安基金管理有限公司,历任债券交易员、基金经理助理,2013年7月起任诺安货币市场基金基金经理。

注:①此处的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

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》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》及其他有关法律法规,遵守了《诺安货币市场基金基金合同》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

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《诺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、债券的一级市场申购、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

2014年上半年,在宏观经济数据低迷,通胀维持低位的背景下,央行连续定向降准,债券市场多头情绪显著回暖。央行公开市场操作力度温和,资金面持续宽裕,债券市场走出了较为明显的牛市行情,各期限和等级的债券收益率下行幅度普遍较大。

作为“现金管理工具”,诺安货币市场基金始终把流动性管理作为重中之重。灵活进行逆回购和协议存款运作,在流动性的关键时点,安排相应的资金到期,使资产保持较强的流动性,以满足投资者日常的申购、赎回需求。诺安货币市场基金始终坚持“确保本金的安全性、资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益”,注重信用风险的控制,严格执行内部债券评级制度,确保资产的安全性。在投资管理过程中,注重控制投资、交易及操作风险,对基金资产进行合理配置。在投资组合方面,基金密切关注市场流动性变化,择时进行逆回购和协议存款运作,并紧跟宏观经济走势,分析政策面动向,把握市场热点的转化和收益率的走势,选择合适期限、等级的短融进行投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金投资组合的剩余期限为145天,影子定价偏离度为正的0.2058%。本报告期诺安货币A基金份额净值收益率为2.1278%,诺安货币A的同期业绩比较基准收益率为0.1760%;诺安货币B基金份额净值收益率为2.2501%,诺安货币B的同期业绩比较基准收益率为0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看,政策微刺激效果有所显现,短期经济有企稳的迹象,但经济增长的内生动力不足,受房地产周期拖累,中期来看,下行压力巨大。在通胀预期较弱,保增长成为首要目标的情况下,货币政策的宽松仍有一定空间。在新股连续发行的情况下,资金面可能会受到阶段性冲击,但整体上,稳中偏松的货币政策将为资金的充裕保驾护航,下半年流动性仍将维持宽松的局面,中等级短融具有较好的配置价值。

接下来,我们将继续灵活运用逆回购和协议存款,在保证资产的流动性和安全性的基础上,秉持债券分散化投资的原则,通过合理调整债券资产比例,动态释放收益,为投资者创造更高的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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》估值业务及份额净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,基金份额净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,不介入基金日常估值业务,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,保持估值政策和程序的一贯性。

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

根据本基金基金合同约定,本基金收益“每日分配、按月支付”。本基金本期实现利润为63,259,813.91元,应分配利润63,259,813.91元,已实施利润分配63,259,813.91元,符合本基金合同约定。

§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,诺安货币市场基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安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、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安货币市场基金2014年半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。

§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:诺安货币市场基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

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	204,181,266.62	1,291,872,482.59
结算备付金	55,000.00	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,012,332,826.45	1,021,033,098.34
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,012,332,826.45	1,021,033,098.34
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,852,909,251.00	2,704,852,933.28
应收证券清算款	-	-
应收利息	39,274,437.30	24,745,468.55
应收股利	-	-
应收申购款	73,173,455.71	639,505,429.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,181,926,237.08	5,682,009,412.68
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	205,799,291.30	-
应付证券清算款	-	190,000,000.00
应付赎回款	1,170.05	472.16
应付管理人报酬	1,867,787.61	632,058.92
应付托管费	565,996.27	191,533.02
应付销售服务费	174,221.53	276,822.95
应付交易费用	58,975.35	75,778.70
应交税费	417,600.00	417,600.00
应付利息	189,397.19	-
应付利润	4,068,673.47	4,507,743.82
递延所得税负债	-	-
其他负债	192,340.54	149,002.84
负债合计	213,335,453.31	196,251,012.41
所有者权益:		
实收基金	4,968,590,783.77	5,485,758,400.27
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,968,590,783.77	5,485,758,400.27
负债和所有者权益总计	5,181,926,237.08	5,682,009,412.68

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4,968,590,783.77份,其中,诺安货币A基金份额净值1.0000元,基金份额总额636,694,060.62份;诺安货币B基金份额净值1.0000元,基金份额总额4,331,896,723.15份。

6.2 利润表

会计主体:诺安货币市场基金

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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	98,510,671.70	73,038,354.77
1.利息收入	93,623,660.21	63,682,293.32
其中:存款利息收入	22,198,656.34	5,821,213.83
债券利息收入	37,455,306.22	32,148,587.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	33,969,697.65	25,712,492.24
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	4,887,011.49	9,345,174.74
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,887,011.49	9,345,174.74
资产支持证券投资收益	-	-
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)	-	10,886.71
减:二、费用	11,570,780.51	9,778,540.86
1.管理人报酬	6,958,987.60	5,869,408.80
2.托管费	2,108,784.17	1,778,608.61
3.销售服务费	1,302,477.89	965,254.56
4.交易费用	33.00	-
5.利息支出	967,241.41	883,922.28
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	233,256.44	281,346.61
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	86,939,891.19	63,259,813.91
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	86,939,891.19	63,259,813.91

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安货币市场基金

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)	5,485,758,400.27	-	5,485,758,400.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	86,939,891.19	86,939,891.19
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)	-517,167,616.50	-	-517,167,616.50
其中:1.基金申购款	17,367,123,811.07	-	17,367,123,811.07
2.基金赎回款	-17,884,291,427.57	-	-17,884,291,427.57
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)	-	-86,939,891.19	-86,939,891.19
五、期末所有者权益(基金净值)	4,968,590,783.77	-	4,968,590,783.77
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)	2,300,089,867.09	-	2,300,089,867.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	63,259,813.91	63,259,813.91
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)	246,949,495.55	-	246,949,495.55
其中:1.基金申购款	10,693,077,977.97	-	10,693,077,977.97
2.基金赎回款	-10,446,128,482.42	-	-10,446,128,482.42
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)	-	-63,259,813.91	-63,259,813.91
五、期末所有者权益(基金净值)	2,547,039,362.64	-	2,547,039,362.64

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	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	托管人、代销机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

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	6,958,987.60	5,869,408.80
其中:支付销售机构的客户维护费	745,672.27	201,745.69

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的基金管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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	2,108,784.17	1,778,608.61

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计算,计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的基金托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,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		
	诺安货币A	诺安货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	686,385.54	131,955.73	818,341.27
中国工商银行股份有限公司(托管人)	231,746.96	6,676.65	238,423.61
合计	918,132.50	138,632.38	1,056,764.88
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		
	诺安货币A	诺安货币B	合计
诺安基金管理有限公司(管理人)	451,928.07	135,180.74	587,108.81
中国工商银行股份有限公司(托管人)	211,345.74	1,392.71	212,738.45
合计	663,273.81	136,573.45	799,847.26

注:本基金实行销售服务费分级收费方式,分设两级基金份额:A级基金份额和B级基金份额,A级基金份额销售服务费年费率为0.25%,B级基金份额销售服务费年费率为0.01%。

各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

H=E×R÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

R为该级基金份额的销售服务费率

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首五个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由基金管理人支付给各销售机构,若遇法定节假日、休息日等,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

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
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	111,600,000.00	11,251.73
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
中国工商银行股份有限公司	-	257,977,747.94	-	-	-	-

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无投资本基金的情况。

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。

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
中国工商银行股份有限公司	4,181,266.62	145,287.84	19,777,234.65	87,996.21

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按适用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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

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为205,799,291.30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
140204	14国开04	2014年7月1日	100.45	1,000,000	100,450,000.00
140327	14进出27	2014年7月1日	100.26	400,000	40,104,000.00
130236	13国开36	2014年7月4日	100.02	600,000	60,012,000.00
130243	13国开43	2014年7月4日	100.11	100,000	10,011,000.00
合计				2,100,000	210,577,000.00

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,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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,其账面价值接近于公允价值。

(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

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

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二层级的余额为3,012,332,826.45元,无属于第一层级或第三层级的余额(2013年12月31日:第二层级1,021,033,098.34元,无属于第一层级或第三层级的余额)。

③公允价值所属层级间的重大变动

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入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

无。

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	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,012,332,826.45	58.13
	其中:债券	3,012,332,826.45	58.13
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,852,909,251.00	35.76
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	202,485,979.45	3.91
3	银行存款和结算备付金合计	204,236,266.62	3.94
4	其他各项资产	112,447,893.01	2.17
5	合计	5,181,926,237.08	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	1.04	
	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	205,799,291.30	4.14
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本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20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	145
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	171
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

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	43.22	4.14
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.02	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	3.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.62	-
4	90天(含)—180天	7.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	45.91	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		102.03	4.14

7.4 期末按债券品种分