

天弘增利宝货币市场基金

2014年半年度报告摘要

2014年06月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2014年08月26日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月22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。

本半年度报告摘要来自半年度报告正文，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2014年6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	天弘增利宝货币
基金主代码	000198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年05月29日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	574,160,399,371.82份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

### 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		天弘基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	朱义明
	联系电话	022-83310208	010-65556899
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhuyiming@citicib.com.cn
客户服务电话		022-83310988 4007109999	95558
传真		022-83865569	010-65550832

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

### § 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

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-2014年6月30日）
本期已实现收益	12,548,223,365.34
本期利润	12,548,223,365.34
本期净值收益率	2.6778%
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	574,160,399,371.82
期末基金份额净值	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、本基金的利润分配是按日结转份额。

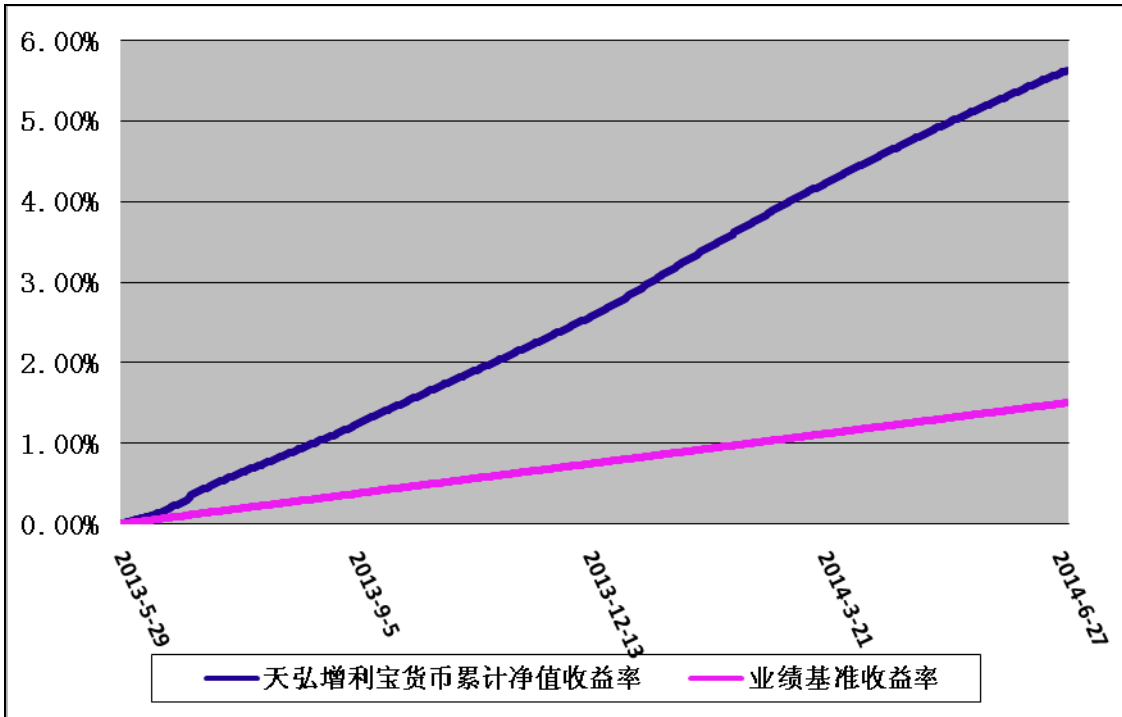
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	0.3659%	0.0005%	0.1126%	0.0000%	0.2533%	0.0005%
过去三个月	1.1940%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.8522%	0.0008%
过去六个月	2.6778%	0.0019%	0.6810%	0.0000%	1.9968%	0.0019%
过去一年	5.2196%	0.0017%	1.3781%	0.0000%	3.8415%	0.0017%
自基金合同生效日起至今	5.6272%	0.0021%	1.5037%	0.0000%	4.1235%	0.0021%

注：天弘增利宝货币市场基金业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

##### 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



注：1、本基金合同于2013年5月29日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## § 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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为1.8亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司（持股比例48%）、内蒙古君正能源化工股份有限公司（持股比例36%）、芜湖高新投资有限公司（持股比例16%）。截至2014年6月30日，本基金管理人共管理十六只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利分级债券型证券投资基金、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘增利宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金和天弘季加利理财债券型证券投资基金。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王登峰	本基金基金经理、天弘现金管理货币市场基金基金经理、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金经理。	2013年05月	-	5	男，硕士研究生。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司，历任固定收益研究员。

注：1、上述任职日期为基金合同生效日。

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。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在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

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度，经济下行压力较大，2季度，政府开始着手稳增长，财政政策层面项目审批进度加快、财政资金投放力度加强，货币政策层面央行通过定向降准、再贷款等方式向银行体系注入流动性，为稳增长保驾护航，在前期刺激政策作用下，6月份经济触底反弹，但经济中长期压力依然较大，上半年物价走势总体维持平稳。对于债券和货币市场而言，在经济偏弱，货币政策渐趋宽松的背景下，2014年上半年资金面整体宽松，资金利率中枢较2013年下半年大幅下行，存款利率下行，短期融资券利率也呈现下行趋势。

本基金在报告期内，始终坚持将风险控制放在组合管理的第一位，充分发挥互联网货币基金大数据分析在组合管理上的优势，根据申购、赎回预测情况进行资产到期布局，结合市场资金面情况，灵活调整组合配置。资产配置上，春节前夕充分利用资金利率高企时机拉长组合久期；3月受舆论关注较大期间，增加了短期资产布局以应对可能的流动性冲击；半年末再度提高组合剩余期限。在信用风险控制上，存款银行坚持以四大行及大型股份制银行为主，债券配置上以短久期、无风险利率债及高评级企业债为主，



确保了信用风险零发生。本基金在报告期内坚守“稳健理财”的投资理念，为持有人创造了稳健、合理的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金本报告期份额净值收益率2.6778%，同期业绩比较基准收益率0.6810%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简单展望

展望2014年下半年，前期积极财政政策、相对宽松货币政策初见成效，短期来看经济已经开始企稳回升，但受制于房地产下行周期，长期来看经济仍面临较大下行压力，因此仍需政策层面给予配合，货币政策难以边际收紧；物价方面，受食品价格周期及CPI翘尾因素影响，今年4季度开始，通胀将面临较大压力，受制于通胀压力，货币政策难以大幅全面宽松；综合来看，货币政策有望继续通过定向宽松方式维持中性基调，资金面有望维持平稳。对债券和货币市场而言，债券收益率受供需格局影响大幅下行空间不足，货币政策定向宽松背景下，短端货币市场利率有望低位震荡，存款利率、短期融资券利率有望维持平稳，但受打新股等因素影响，不排除个别时点资金利率超预期上行的可能，届时将带动货币市场投融资利率的上行。

本基金将继续秉承“稳健理财”的投资理念，严格控制好流动性风险、信用风险及价格风险，将大数据分析及市场资金面判断有机结合起来，根据互联网货币基金的独有特点，灵活调整组合配置，在风险可控的基础上，继续为持有人创造持续、稳定、合理的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定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（该收益参与下一日的收益分配），并按自然日结转至基金份额持有人的基金账户。

## § 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

自2013年5月29日天弘增利宝货币市场基金（以下简称“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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和基金合同的有关规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人一天弘基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产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进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

由本基金管理人一天弘基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：天弘增利宝货币市场基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	501,446,435,713.37	175,541,017,053.14
结算备付金		61,273,000.01	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	33,224,175,455.08	12,762,005,913.59
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		32,814,207,043.92	12,762,005,913.59
资产支持证券投资		409,968,411.16	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	53,179,730,915.99	1,580,737,687.37
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,200,075,567.28	492,025,474.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		589,111,690,651.73	190,375,786,128.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		6,999,996,560.00	4,949,996,640.00
应付证券清算款		7,645,203,107.91	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		145,144,043.31	39,100,241.16

应付托管费		38,705,078.21	10,426,730.96
应付销售服务费		120,953,369.42	32,583,534.31
应付交易费用	6.4.7.7	196,210.96	101,301.04
应交税费		-	-
应付利息		761,172.06	1,327,955.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	331,738.04	234,000.00
负债合计		14,951,291,279.91	5,033,770,402.91
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	574,160,399,371.82	185,342,015,725.98
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		574,160,399,371.82	185,342,015,725.98
负债和所有者权益总计		589,111,690,651.73	190,375,786,128.89

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.00元，基金份额总额574,160,399,371.82份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘增利宝货币市场基金

本报告期：2014年1月1日-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5月29日(基 金合同生效日)至 2013年6月30日
<b>一、收入</b>		14,079,667,873.32	6,347,915.05
1. 利息收入		14,029,954,494.86	6,347,915.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,507,071,248.25	6,315,248.43
债券利息收入		391,878,107.57	-
资产支持证券利息收入		1,863,931.71	-
买入返售金融资产收入		129,141,207.33	32,666.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,588,083.93	-
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	49,588,083.93	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

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）	6. 4. 7. 14	125, 294. 53	-
<b>减：二、费用</b>		1, 531, 444, 507. 98	604, 143. 48
1. 管理人报酬		724, 458, 243. 54	271, 383. 98
2. 托管费		193, 188, 864. 91	72, 369. 08
3. 销售服务费		603, 715, 203. 01	226, 153. 33
4. 交易费用	6. 4. 7. 15	-	-
5. 利息支出		9, 542, 873. 26	-
其中：卖出回购金融资产支出		9, 542, 873. 26	-
6. 其他费用	6. 4. 7. 16	539, 323. 26	34, 237. 09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12, 548, 223, 365. 34	5, 743, 771. 57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12, 548, 223, 365. 34	5, 743, 771. 57

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘增利宝货币市场基金

本报告期：2014年1月1日-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）	185, 342, 015, 725. 98	-	185, 342, 015, 725. 98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12, 548, 223, 365. 34	12, 548, 223, 365. 34
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）	388, 818, 383, 645. 84	-	388, 818, 383, 645. 84
其中：1. 基金申购款	1, 639, 884, 060, 685. 08	-	1, 639, 884, 060, 685. 08
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1, 251, 065, 677, 039. 24	-	-1, 251, 065, 677, 039. 24
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）	-	-12, 548, 223, 365. 34	-12, 548, 223, 365. 34

五、期末所有者权益 (基金净值)	574,160,399,371.82	-	574,160,399,371.82
项 目	上年度可比期间 2013年5月29日(基金合同生效日)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)	200,628,721.85	-	200,628,721.85
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	5,743,771.57	5,743,771.57
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)	4,043,505,511.84	-	4,043,505,511.84
其中: 1. 基金申购款	5,061,577,368.05	-	5,061,577,368.05
2. 基金赎回款	-1,018,071,856.21	-	-1,018,071,856.21
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)	-	-5,743,771.57	-5,743,771.57
五、期末所有者权益 (基金净值)	4,244,134,233.69	-	4,244,134,233.69

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:

郭 树 强

韩 海 潮

薄 贺 龙

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 基金基本情况

天弘增利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]692号《关于核准天弘增利宝货币市场基金募集的批复》核准,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘增利宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集200,628,721.85元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第306号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘增利宝货币市场基金基金合同》于2013年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,628,721.85份基金份额,其中认购资金利息折合0.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘增利宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银



行定期存款和大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘增利宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 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

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.7.2 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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 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5月29日(基金合同生效 日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	724,458,243.54	271,383.98
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

###### 6.4.8.2.2 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5月29日(基金合同生效 日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	193,188,864.91	72,369.08

注：支付基金托管人中信银行的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。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

###### 6.4.8.2.3 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	上年度可比期间 2013年5月29日(基金合同生效 日)至2013年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
天弘基金管理有限公司	603,715,203.01	226,153.33

注：支付基金管理人天弘基金管理有限公司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。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

##### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

中信银行	122,878,201.64	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年5月29日(基金合同生效日)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
中信银行	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 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除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额的情况。

#### 6.4.8.5 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5月29日(基金合同生效日)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
中信银行	149,535,435,713.37	2,472,750,805.63	989,799,778.86	1,444,554.06

注：本基金的银行存款有基金托管中信银行保管，按银行同业利率计息

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.8.7 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无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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)，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。

##### 6.4.9.2 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)，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 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6,999,996,560.00元，是以如下债券作为抵押：

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
130322	13进出22	2014-7-2	100.07	20,000,000	2,001,400,000.00
110413	11农发13	2014-7-2	100.01	40,000,000	4,000,400,000.00
130236	13国开36	2014-7-2	100.02	10,000,000	1,000,200,000.00
合计	-	-	-	70,000,000	7,002,000,000.00

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2014年6月30日),本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.10 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,其账面价值与公允价值相差很小。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (b) 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且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层级的余额,属于第二层级的余额为33,224,175,455.08元,无属于第三层级的余额。

##### (c) 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。

##### (d) 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	33,224,175,455.08	5.64
	其中：债券	32,814,207,043.92	5.57
	资产支持证券	409,968,411.16	0.07
2	买入返售金融资产	53,179,730,915.99	9.03
	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	501,507,708,713.38	85.13
4	其他资产	1,200,075,567.28	0.20
5	合计	589,111,690,651.73	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	0.18	
	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	6,999,996,560.00	1.22
	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比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值；对于货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未有超过基金资产净值20%的情况。

### 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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未发生本货币市场基金投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

#### 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	28.55	2.55
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	24.51	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	33.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	0.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.40	2.55

#### 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	26,053,928,522.50	4.54
	其中：政策性金融债	26,053,928,522.50	4.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,760,278,521.42	1.18
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	32,814,207,043.92	5.72
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名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	090306	09进出06	46,800,000	4,689,468,528.47	0.82

2	110413	11农发13	42,600,000	4,261,065,087.00	0.74
3	130322	13进出22	35,200,000	3,524,347,590.26	0.61
4	130236	13国开36	26,150,000	2,616,008,588.38	0.46
5	110418	11农发18	25,800,000	2,575,325,953.44	0.45
6	130227	13国开27	24,900,000	2,490,028,844.12	0.43
7	090411	09农发11	12,200,000	1,221,957,105.91	0.21
8	130418	13农发18	8,300,000	830,285,834.09	0.14
9	130314	13进出14	6,700,000	670,085,113.70	0.12
10	140207	14国开07	4,700,000	471,659,874.12	0.08

## 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	0.0062%
报告期内偏离度的最低值	-0.0002%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0036%

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1489035	14开元3A1	2,350,000	235,587,500.00	0.04
2	1489050	14甬银1A1	1,750,000	176,277,500.00	0.03

## 7.8 投资组合报告附注

### 7.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金

管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7.8.2 本报告期内，未发生本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

7.8.3 本报告期内，未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,200,075,567.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,200,075,567.28

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 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

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
123,848,098	4,636.00	2,336,629,620.28	0.41%	571,823,769,751.54	99.59%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	12,871,212.02	0.00%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10



§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年05月29日)基金份额总额	200,628,721.85
本报告期期初基金份额总额	185,342,015,725.98
本报告期期间基金总申购份额	1,639,884,060,685.08
本报告期期间基金总赎回份额	1,251,065,677,039.24
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	574,160,399,371.82

注：1、本基金合同生效日为2013年5月29日。  
2、总申购份额含红利再投的基金份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本基金托管人中信银行于2014年2月27日公告，因工作需要，刘勇先生不再担任中信银行资产托管部总经理，任命刘泽云先生为中信银行资产托管部副总经理，并主持资产托管部相关工作。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有发生改变。

### 10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 10.6 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	-	-	79,604,000,000.00	100.00%	-	-	无

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

### 10.7 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

天弘基金管理有限公司

二零一四年八月二十六日