

# 农银汇理红利日结货币市场基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	44
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>45</b>
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	农银汇理红利日结货币市场基金	
基金简称	农银红利日结货币	
基金主代码	000907	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 12 月 19 日	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
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	4,947,773,409.05 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	农银红利日结货币 A	农银红利日结货币 B
下属分级基金的交易代码:	000907	000908
报告期末下属分级基金的份额总额	2,989,319,877.91 份	1,958,453,531.14 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、利率策略。基金管理人将通过跟踪分析 GDP、利率水平、通货膨胀、货币供应、就业水平、国际利率水平、汇率等宏观经济指标，考察宏观经济及货币政策对债券市场的影响，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上，建立对预期利率走势的基本判断。</p> <p>2、类属配置策略。类属配置指组合在央行票据、债券回购、短期债券以及现金等投资品种之间的配置比例。</p> <p>3、个券选择策略。本基金将在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并找出因投资者偏好、供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择出估值较低的债券品种。</p> <p>4、相对价值策略。基金管理人将在保证基金的安全性和流动性的前提下，适当参与市场的套利，捕捉和把握无风险套利机会，进行跨市场、跨品种操作，以期获得安全的超额收益。</p> <p>5、银行存款投资策略。基金根据不同银行的银行存款收益率情况，结合银行的信用等级、存款期限等因素的分析，以及对整体利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资。</p> <p>6、流动性管理策略。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。</p>

业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
	农银红利日结货币 A	农银红利日结货币 B

## 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	农银汇理基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东
	联系电话	021-61095588
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com
客户服务电话	021-61095599	010-67595096
传真	021-61095556	010-66275853
注册地址	上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场7层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	刁钦义	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	农银汇理基金管理有限公司	上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层

## § 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	农银红利日结货币 A	农银红利日结货币 B
------	------------	------------

3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日 )	报告期( 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	127, 106, 090. 13	65, 648, 183. 03
本期利润	127, 106, 090. 13	65, 648, 183. 03
本期净值收益率	2. 1813%	2. 3039%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	2, 989, 319, 877. 91	1, 958, 453, 531. 14
期末基金份额净值	1. 0000	1. 0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	2. 4702%	2. 6013%

注：1、本基金申购赎回费为零；

2、本基金收益分配按日结转份额；

3、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。

4、本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日。

## 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

农银红利日结货币 A

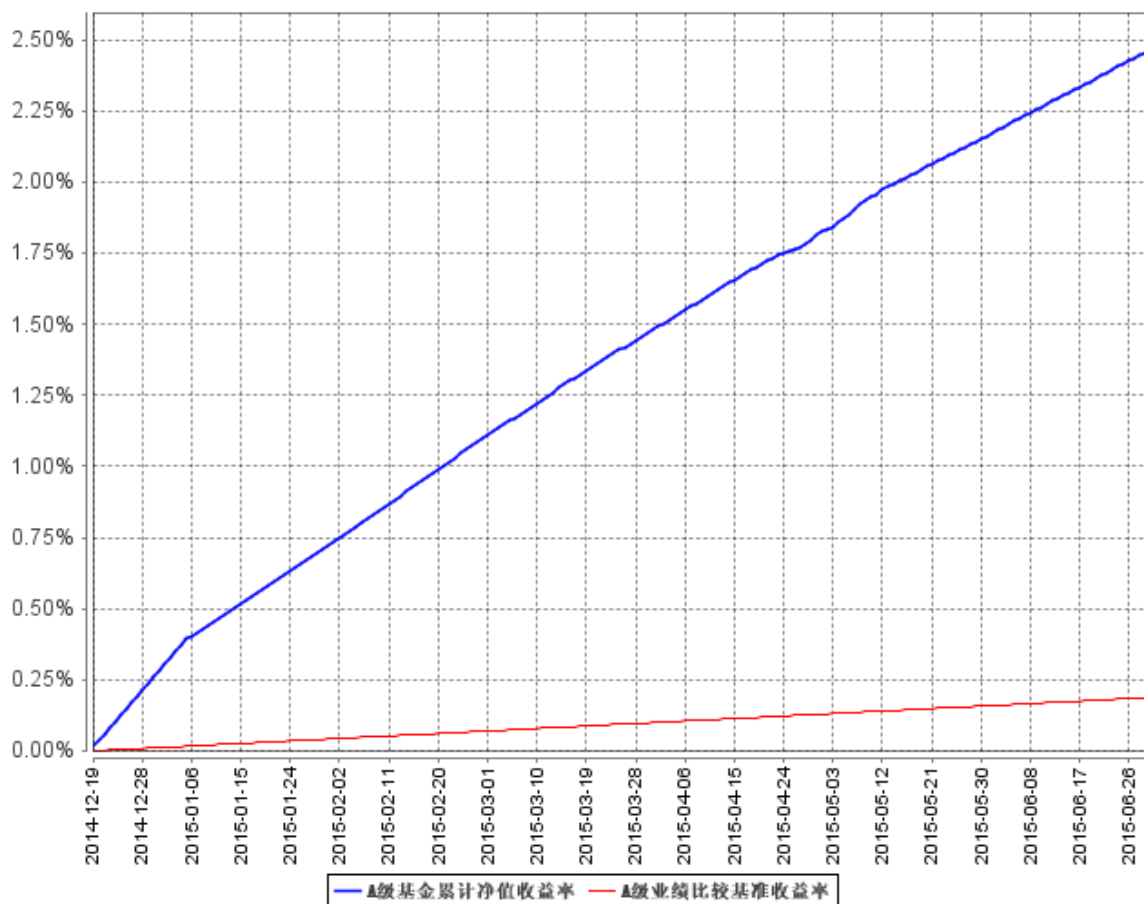
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0. 3021%	0. 0012%	0. 0292%	0. 0000%	0. 2729%	0. 0012%
过去三个月	0. 9743%	0. 0024%	0. 0885%	0. 0000%	0. 8858%	0. 0024%
过去六个月	2. 1813%	0. 0027%	0. 1760%	0. 0000%	2. 0053%	0. 0027%
自基金合同生效起至今	2. 4702%	0. 0036%	0. 1886%	0. 0000%	2. 2816%	0. 0036%

农银红利日结货币 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. 3221%	0. 0013%	0. 0292%	0. 0000%	0. 2929%	0. 0013%
过去三个月	1. 0352%	0. 0024%	0. 0885%	0. 0000%	0. 9467%	0. 0024%
过去六个月	2. 3039%	0. 0027%	0. 1760%	0. 0000%	2. 1279%	0. 0027%
自基金合同生效起至今	2. 6013%	0. 0036%	0. 1886%	0. 0000%	2. 4127%	0. 0036%

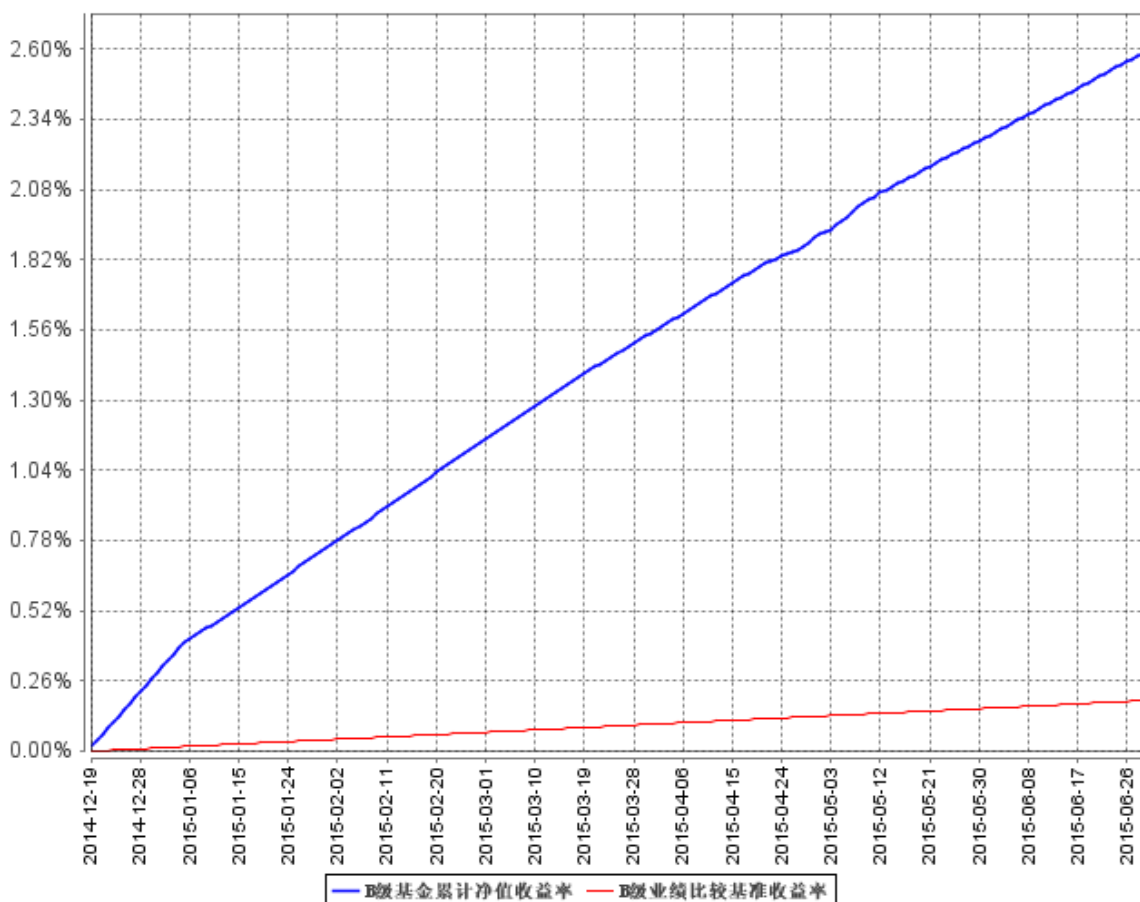
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**





B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



1. 本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，至 2015 年 6 月 30 日不满一年。
2. 本基金主要投资于货币市场金融工具：现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和 大额存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、期限在一年以内(含一年)的中央银行 票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天) 的资产支持类证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。 本基金建仓期为基金合同生效日(2014 年 12 月 19 日)起六个月，建仓期满时，本基金各项投资 比例已达到基金合同规定的投资比例。

## § 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

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司 注册资本为人民币贰亿零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理

资产管理公司出资比例为 33.33%，中国铝业股份有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。公司法定代表人为董事长刁钦义先生。

截止 2015 年 6 月 30 日，公司现管理 25 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长股票型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值股票型证券投资基金、农银汇理中小盘股票型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹股票型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选股票型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题股票型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动股票型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长股票型证券投资基金、农银汇理行业领先股票型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金和农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金。

#### 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许娅	本基金基金经理	2014 年 12 月 19 日	-	7	金融学硕士。历任中国国际金融有限公司销售交易部助理、国信证券经济研究所销售人员、中海基金管理有限公司交易员、农银汇理基金管理有限公司债券交易员。现任农银

					汇理基金 管理有限 公司基金 经理。
--	--	--	--	--	-----------------------------

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金管理人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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

### 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。

未发生本基金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

今年一季度货币市场资金一直处于偏紧状态，其中有春节取现因素，IPO 叠加效应以及财政缴款等等，2 月份央行进行了一次降准一次降息，并开始引导资金利率下行，但整体看一季度的资金利率仍维持了较高的价格，四五月份资金利率一路下行，至 6 月又有小幅走高。相对一季度异常紧张的局面，二季度的宽松符合市场预期。相反地，一季度债券市场的收益率则一直维持较低水平，显示市场充分预期了后续仍可能有降息空间，二季度在宽货币的前提下，仍不断有信用债违约事件的发生，天威集团、珠海中富纷纷爆出违约，逐步打破刚性兑付，引发市场对于低评

级债券的担忧，6 月开始收益率整体小幅上行，低评级债券收益率上行明显。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值收益率 2.1813%，B 类份额净值收益率 2.3039%，同期业绩比较基准收益率 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

红利日结基金于去年底成立，在一月份打开申购赎回，在成立初期有个不错的开端，一季度受益于春节、财政缴款等等因素带来的资金利率的持续高企影响，基金保持了较高的静态万份收益，为投资者带来了稳定的投资收益，由于整体处于降息周期以及流动性非常宽松的情况，红利日结基金二季度静态万份收益有所降低，我们仍将通过配置多元化的投资品种以期获取更多高收益的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《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》（证监会计字[2007]21 号）与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2008]38 号）等文件，本公司制订了证券投资基金估值政策和程序，并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责：公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释，并定期对估值政策和程序进行评价，在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化，书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部，运营部参考测算结果对估值调整进行试算，并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督，根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员，均具有基金从业资格，具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具

体证券估值的利益需求，但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度，如估值委员会表决时，其仅有一票表决权，遵守少数服从多数的原则。

本公司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**

根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以各类基金份额的每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。报告期内本基金向 A 级份额持有人分配利润 127106090.13 元，向 B 级份额持有人分配利润 65648183.03 元。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内，本基金未出现上述情形。

## **§ 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关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 192,754,273.16 元，其中农银红利日结货币 A 实施利润分配的金额为 127,106,090.13 元，农银红利日结货币 B 实施利润分配的金额为 65,648,183.03 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：农银汇理红利日结货币市场基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,807,523,463.91	15,572,764,796.56
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,695,601,795.29	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,695,601,795.29	-
资产支持证券投资		-	-
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	369,702,994.55	2,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	64,368,834.34	47,117,577.62
应收股利		-	-
应收申购款		90,130,540.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	23,259.60	-
资产总计		5,027,350,887.69	15,621,882,374.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		73,999,763.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,310,382.05	-
应付管理人报酬		1,743,517.89	1,692,083.77
应付托管费		528,338.74	512,752.66
应付销售服务费		779,410.63	921,245.63
应付交易费用	6.4.7.7	47,055.70	-
应交税费		-	-
应付利息		2,548.23	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	166,462.40	-
负债合计		79,577,478.64	3,126,082.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,947,773,409.05	15,618,756,292.12
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,947,773,409.05	15,618,756,292.12
负债和所有者权益总计		5,027,350,887.69	15,621,882,374.18

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,947,773,409.05 份。其中 A 级 2,989,319,877.91 份，B 级 1,958,453,531.14 份。

2、本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，本报告期为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：农银汇理红利日结货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		222,152,303.92	-
1.利息收入		220,190,322.42	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	190,001,727.90	-
债券利息收入		21,736,115.48	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,452,479.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,961,981.50	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,961,981.50	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-

<b>减：二、费用</b>		29,398,030.76	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,082,659.83	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,267,472.65	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,219,878.40	-
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		3,596,887.62	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,596,887.62	-
6. 其他费用	6.4.7.20	231,132.26	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		192,754,273.16	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		192,754,273.16	-

本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，本报告期为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日，无上年度可比区间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理红利日结货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	15,618,756,292.12	-	15,618,756,292.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	192,754,273.16	192,754,273.16
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）	-10,670,982,883.07	-	-10,670,982,883.07
其中：1. 基金申购款	35,700,562,155.42	-	35,700,562,155.42
2. 基金赎回款	-46,371,545,038.49	-	-46,371,545,038.49
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）	-	-192,754,273.16	-192,754,273.16
五、期末所有者权益（基金净值）	4,947,773,409.05	-	4,947,773,409.05



项目	上年度可比期间 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，无上年度可比区间。

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：

          许金超                                          王梅华                                          于意            
 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

农银汇理红利日结货币市场基金(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[2014]1191 号《关于准予农银汇理红利日结货币市场基金注册的批复》核准，由农银汇理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《农银汇理红利日结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 15,572,854,875.44 元，业经普华永道会计师事务所普华永道中天验字(2014)第 782 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《农银汇理红利日结货币市场基金基金合同》于 2014 年 12 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 15,574,349,029.22 基金份额，其中认购资金利息折合 1,494,153.78 份基金份额。本基金的基金

管理人为农银汇理基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《农银汇理红利日结货币市场基金基金合同》和《农银汇理红利日结货币市场基金招募说明书》的规定，本基金设 A 类和 B 类两类基金份额，不同类别的基金份额适用不同费率的销售服务费；并根据投资者基金交易账户所持有份额数量是否不低于 500 万份进行不同类别基金份额的判断和处理。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《农银汇理红利日结货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率(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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金合同》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。

#### **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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 6.4.4.8 损益平准金

无。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金

份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并以红利再投资形式每日全部按份额面值 1.00 元分配结转至实收基金科目。每个运作期到期日将该运作期收益结转到投资人基金账户。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于

2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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。

(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，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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	2,523,463.91
定期存款	2,805,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月至一年	2,805,000,000.00
其他存款	-
合计：	2,807,523,463.91

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金本期发生定期存款提前支取，未造成利息损失。

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,695,601,795.29	1,706,043,000.00	10,441,204.71	0.2110%
	合计	1,695,601,795.29	1,706,043,000.00	10,441,204.71	0.2110%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本，偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	369,702,994.55	-
合计	369,702,994.55	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	13,662.29
应收定期存款利息	38,041,230.66
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	25,600,799.34



应收买入返售证券利息	700,953.01
应收申购款利息	12,189.04
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	64,368,834.34

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	20,000.00
待摊费用	3,259.60
合计	23,259.60

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	47,055.70
合计	47,055.70

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,719.24
预提费用	160,743.16
合计	166,462.40

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

农银红利日结货币 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,041,455,443.31	11,041,455,443.31

本期申购	19,301,188,529.44	19,301,188,529.44
本期赎回(以“-”号填列)	-27,353,324,094.84	-27,353,324,094.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,989,319,877.91	2,989,319,877.91

金额单位：人民币元

农银红利日结货币 B		
项目	本期	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,577,300,848.81	4,577,300,848.81
本期申购	16,399,373,625.98	16,399,373,625.98
本期赎回(以“-”号填列)	-19,018,220,943.65	-19,018,220,943.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,958,453,531.14	1,958,453,531.14

注：1、申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

2、本基金自 2014 年 12 月 3 日至 2014 年 12 月 16 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 15,572,854,875.44 元。根据《农银汇理红利日结货币市场基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 1,494,153.78 元，在本基金成立后，折算为 1,494,153.78 份基金份额，划入基金份额持有人账户；

3、根据《农银汇理红利日结货币市场基金基金合同》的相关规定，本基金于 2014 年 12 月 19 日(基金合同生效日)至 2015 年 1 月 4 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2015 年 1 月 5 日起开始办理；

4、本基金合同自 2014 年 12 月 19 日起生效。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

农银红利日结货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	127,106,090.13	-	127,106,090.13
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-127,106,090.13	-	-127,106,090.13
本期末	-	-	-

单位：人民币元

农银红利日结货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	65,648,183.03	-	65,648,183.03
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-65,648,183.03	-	-65,648,183.03
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	332,545.38
定期存款利息收入	189,441,085.99
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,233.51
其他	225,863.02
合计	190,001,727.90

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,961,981.50
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,961,981.50

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,234,882,010.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,192,177,231.50
减：应收利息总额	40,742,797.39
买卖债券差价收入	1,961,981.50

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

本基金本报告期内无交易费用。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	32,728.42
信息披露费	119,014.74
账户服务费	5,326.70
清算所账户服务费	4,913.70
银行汇划费	69,148.70
合计	231,132.26

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

本基金无需要披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 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
农银汇理基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，无上年度可比区间。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 债券回购交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,082,659.83	-
其中：支付销售机构的	5,582,317.08	-

客户维护费		
-------	--	--

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，无上年度可比区间。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	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	4,267,472.65	-

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，无上年度可比区间。

#### 6.4.10.2.3 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		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	农银红利日结货币 A	农银红利日结货币 B	合计
农银汇理	12,784.58	47,204.55	59,989.13
农业银行	6,918,636.60	90,401.20	7,009,037.80
建设银行	62,714.55	2,954.90	65,669.45
合计	6,994,135.73	140,560.65	7,134,696.38
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	农银红利日结货币 A	农银红利日结货币 B	合计

注：1、本基金实行销售服务费分级收费方式，分设 A、B 两级：A 级基金按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提销售服务费，B 级基金按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提销售服务费。其计算公式为：A 级基金日销售服务费=前一日 A 级基金资产净值×0.25%/当年天数，B 级基金日销售服务费=前一日 B 级基金资产净值×0.01%/当年天数。

2、本基金合同自 2014 年 12 月 19 日起生效, 无上年度可比区间。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4.2 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无投资本基金的情况。

### 6.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	2,523,463.91	332,545.38	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

本基金合同生效日为 2014 年 12 月 19 日，无上年度可比区间。

### 6.4.10.6 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无在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

##### 农银红利日结货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
127,106,090.13	-	-	127,106,090.13	-

##### 农银红利日结货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
65,648,183.03	-	-	65,648,183.03	-



## 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 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。

### 6.4.12.2 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因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 73,999,763 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
150202	15 国开 02	2015 年 7 月 1 日	99.94	500,000	49,967,548.13
150307	15 进出 07	2015 年 7 月 1 日	100.32	240,000	24,077,743.34
合计				740,000	74,045,291.47

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在投资运作活动中涉及到的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了专门的风险控制制度和流程来识别、评估上述风险，并通过设定相应的风险指标及其限额、内部控制流程以及管理信息系统，有效的控制和跟踪上述各类风险。

本基金的基金管理人的风险管理机构由董事会稽核及风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部以及各个业务部门组成。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放于本基金的托管人—建设银行，本基金认为与建设银行相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
A-1	1,185,399,130.91	-
A-1 以下	-	-
未评级	510,202,664.38	-
合计	1,695,601,795.29	-

注：未评级的债券投资包括国债、央行票据、政策性银行金融债和超短期融资券

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	2,087,523,463.91	720,000,000.00	-	-	2,807,523,463.91
交易性金融资产	675,699,356.12	1,019,902,439.17	-	-	1,695,601,795.29
买入返售金融资产	369,702,994.55	-	-	-	369,702,994.55
应收利息	-	-	-	64,368,834.34	64,368,834.34
应收申购款	50,014,000.00	-	-	40,116,540.00	90,130,540.00
其他资产	-	-	-	23,259.60	23,259.60
资产总计	3,182,939,814.58	1,739,902,439.17	-	104,508,633.94	5,027,350,887.69
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	73,999,763.00	-	-	-	73,999,763.00
应付赎回款	-	-	-	2,310,382.05	2,310,382.05
应付管理人报酬	-	-	-	1,743,517.89	1,743,517.89
应付托管费	-	-	-	528,338.74	528,338.74
应付销售服务费用	-	-	-	779,410.63	779,410.63
应付交易费用	-	-	-	47,055.70	47,055.70
应付利息	-	-	-	2,548.23	2,548.23
其他负债	-	-	-	166,462.40	166,462.40
负债总计	73,999,763.00	-	-	5,577,715.64	79,577,478.64
利率敏感度缺口	3,108,940,051.58	1,739,902,439.17	-	98,930,918.30	4,947,773,409.05
<b>上年度末 2014年12月31日</b>	<b>6个月以内</b>	<b>6个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	15,422,764,796.56	150,000,000.00	-	-	15,572,764,796.56
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	47,117,577.62	47,117,577.62
资产总计	15,424,764,796.56	150,000,000.00	-	47,117,577.62	15,621,882,374.18

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,692,083.77	1,692,083.77
应付托管费	-	-	-	512,752.66	512,752.66
应付销售服务费用	-	-	-	921,245.63	921,245.63
负债总计	-	-	-	3,126,082.06	3,126,082.06
利率敏感度缺口	15,424,764,796.56	150,000,000.00	-	43,991,495.56	15,618,756,292.12

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金管理人通过设定目标久期管理债券的利率风险，并根据基金合同要求将投资组合平均剩余期限控制在 120 天以内。若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降 25 个基点，对资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

## § 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	1,695,601,795.29	33.73
	其中：债券	1,695,601,795.29	33.73
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	369,702,994.55	7.35
	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	2,807,523,463.91	55.84
4	其他各项资产	154,522,633.94	3.07
5	合计	5,027,350,887.69	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	2.83	
	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	73,999,763.00	1.50
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2015 年 3 月 31 日	20.01	巨额赎回	2 个交易日

## 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	140
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	140
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
1	2015 年 4 月 13 日	121	巨额赎回	4 个交易日
2	2015 年 5 月 7 日	121	巨额赎回	2 个交易日
3	2015 年 5 月 12 日	124	巨额赎回	1 个交易日
4	2015 年 6 月 2 日	123	巨额赎回	6 个交易日
5	2015 年 6 月 18 日	122	巨额赎回	6 个交易日
6	2015 年 6 月 30 日	140	巨额赎回	6 个交易日

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 120 天，下同。

### 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	10.76	1.50
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	28.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	15.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	35.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.49	1.50

### 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	400,255,307.45	8.09
	其中：政策性金融债	400,255,307.45	8.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,295,346,487.84	26.18
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,695,601,795.29	34.27
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	130202	13 国开 02	2,200,000	220,044,723.37	4.45
2	041453118	14 酒钢 CP002	700,000	70,050,338.44	1.42
3	140223	14 国开 23	600,000	60,047,069.89	1.21
4	011581002	15 淮南矿 SCP002	600,000	59,971,426.87	1.21
5	041464068	14 西宁城投 CP001	500,000	50,240,276.39	1.02
6	150307	15 进出 07	500,000	50,161,965.30	1.01
7	041453108	14 昆钢 CP003	500,000	50,059,639.86	1.01
8	071502005	15 国泰君安 CP005	500,000	49,992,443.74	1.01
9	071536003	15 华安证券 CP003	500,000	49,992,253.88	1.01
10	071540003	15 东吴证券 CP003	500,000	49,990,651.51	1.01

## 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2268%
报告期内偏离度的最低值	-0.0129%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0713%

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 投资组合报告附注

### 7.8.1

本基金计价采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.0000 元。

### 7.8.2

本报告期内无持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本超

过当日基金资产净值 20% 的情况。

### 7.8.3

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	应收利息	64,368,834.34
4	应收申购款	90,130,540.00
5	其他应收款	20,000.00
6	待摊费用	3259.60
7	其他	-
8	合计	154,522,633.94

## § 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

份额级别	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
农银红利日结货币 A	76,503	39,074.54	22,532,806.39	0.75%	2,966,787,071.52	99.25%
农银红利	71	27,583,852.55	1,521,454,471.41	77.69%	436,999,059.73	22.31%



日 结 货 币 B						
合 计	76,574	64,614.27	1,543,987,277.80	31.21%	3,403,786,131.25	68.79%

注：本基金机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	农银红利日结货币 A	101,984.72	0.0034%
	农银红利日结货币 B	-	-
	合计	101,984.72	0.0021%

注：从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 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	份额级别	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	农银红利日结货币 A	10~50
	农银红利日结货币 B	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	农银红利日结货币 A	0
	农银红利日结货币 B	0
	合计	0

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 10 万-50 万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	农银红利日结货币 A	农银红利日结货币 B
基金合同生效日（2014 年 12 月 19 日）基金	11,012,838,186.58	4,565,077,256.83

份额总额		
本报告期期初基金份额总额	11,041,455,443.31	4,577,300,848.81
本报告期基金总申购份额	19,301,188,529.44	16,399,373,625.98
减:本报告期基金总赎回份额	27,353,324,094.84	19,018,220,943.65
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,989,319,877.91	1,958,453,531.14

注: 1、总申购份额含红利再投、转换入份额; 总赎回份额含转换出份额。

2、本基金合同自 2014 年 12 月 19 日起生效,

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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,基金管理人农银汇理基金管理有限公司于 2015 年 5 月 28 日公布了《农银汇理基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》,许金超任农银汇理基金管理有限公司总经理职务,施卫不再代为履行副总经理职务;农银汇理基金管理有限公司于 2015 年 4 月 29 日公布了《农银汇理基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》,Laurent Tournier(杜明华)因任职到期而不再担任农银汇理基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

**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**

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

**10.7 基金租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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚, 注册资本不少于 20 亿元人民币。
  - (2)、市场形象及财务状况良好。
  - (3)、经营行为规范, 内控制度健全, 最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
  - (4)、内部管理规范、严格, 具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
  - (5)、研究实力较强, 具有专门的研究机构和专职研究人员, 能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情
- 2、本基金本报告期无新增或剔除交易单元。

**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	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	7,000,000.00	2.01%	-	-
华泰联合	-	-	341,000,000.00	97.99%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内本基金不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	农银汇理基金管理有限公司管理的基金 2014 年年度资产净值公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 1 日
2	农银汇理红利日结货币市场基金在直销开通转换及定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 1 月 7 日
3	关于农银红利日结基金 2015 年春节假期暂停申购及转换转入等业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 2 月 12 日
4	农银汇理基金管理有限公司关	上海证券报、中国证券报、	2015 年 3 月 24

	于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	证券时报、基金管理人网站	日
5	关于农银汇理红利日结货币市场基金 2015 年清明假期暂停申购及转换转入等业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 3 月 31 日
6	农银汇理红利日结货币市场基金 2015 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 4 月 20 日
7	关于农银红利日结基金 2015 年五一假期暂停申购及转换转入等业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 4 月 27 日
8	关于农银红利日结基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 5 月 7 日
9	关于农银红利日结基金 2015 年端午假期暂停申购及转换转入等业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、基金管理人网站	2015 年 6 月 17 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《农银汇理红利日结货币市场基金基金合同》；
- 3、《农银汇理红利日结货币市场基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照复印件；
- 6、本报告期内公开披露的临时公告。

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区银城路 9 号农银大厦 50 层。

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

农银汇理基金管理有限公司  
2015 年 8 月 26 日