

# 兴全货币市场证券投资基金

## 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 24 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

### 1.2 目录

|                                   |          |
|-----------------------------------|----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....           | <b>1</b> |
| 1.1 重要提示 .....                    | 1        |
| 1.2 目录 .....                      | 1        |
| <b>§2 基金简介</b> .....              | <b>3</b> |
| 2.1 基金基本情况 .....                  | 3        |
| 2.2 基金产品说明 .....                  | 3        |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....             | 3        |
| 2.4 信息披露方式 .....                  | 4        |
| 2.5 其他相关资料 .....                  | 4        |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....     | <b>4</b> |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....             | 4        |
| 3.2 基金净值表现 .....                  | 5        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....             | <b>6</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....            | 6        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....  | 7        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....     | 7        |
| 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 ..... | 8        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... | 8        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....    | 9        |

|   |           |
|---|-----------|
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 9         |
| <b>§5 托管人报告 .....</b>                         | <b>9</b>  |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                  | 9         |
| 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 ..... | 10        |
| 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 .....      | 10        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....</b>               | <b>10</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 10        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 11        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 12        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 14        |
| <b>§7 投资组合报告 .....</b>                        | <b>26</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 26        |
| 7.2 债券回购融资情况 .....                            | 26        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....                        | 26        |
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 27        |
| 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 .....      | 27        |
| 7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....          | 28        |
| 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 .....   | 28        |
| 7.8 投资组合报告附注 .....                            | 28        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                     | <b>29</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                   | 29        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                | 29        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                     | <b>29</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                       | <b>30</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                        | 30        |
| 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 .....        | 30        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....             | 30        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                          | 30        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                   | 30        |
| 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 .....           | 30        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                  | 30        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....                  | 31        |
| 10.9 其他重大事件 .....                             | 31        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>               | <b>32</b> |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                       | <b>33</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                             | 33        |
| 12.2 存放地点 .....                               | 33        |
| 12.3 查阅方式 .....                               | 33        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 兴全货币市场证券投资基金     |
| 基金简称       | 兴全货币             |
| 基金主代码      | 340005           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2006 年 4 月 27 日  |
| 基金管理人      | 兴业全球基金管理有限公司     |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 984,314,027.98 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上,使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等,使基金收益达到同期货币市场的收益水平,力争超越业绩比较基准。                |
| 投资策略   | 本基金通过对货币市场短期金融工具的积极稳健投资,在风险和收益中寻找最优组合,在保持本金安全与资产充分流动性的前提下,综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资,追求稳定的现金收益。 |
| 业绩比较基准 | 税后 6 个月银行定期存款利率  |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。  |

### 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      |      | 兴业全球基金管理有限公司             | 兴业银行股份有限公司                      |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 冯晓莲                      | 张志永                             |
|         | 联系电话 | 021-58368998             | 021-62677777                    |
|         | 电子邮箱 | fengxl@xyfunds.com.cn    | zhangzhy@cib.com.cn             |
| 客户服务电话  |      | 4006780099, 021-38824536 | 95561                           |
| 传真      |      | 021-58368858             | 021-62159217                    |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区金陵东路 368 号         | 福州市湖东路 154 号                    |
| 办公地址    |      | 上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼    | 上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼(资产托管部办公地址) |
| 邮政编码    |      | 200122                   | 200041                          |
| 法定代表人   |      | 兰荣                       | 高建平                             |

## 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   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.xyfunds.com.cn">http://www.xyfunds.com.cn</a> |
| 基金半年度报告报告备置地点        | 基金管理人、基金托管人的办公场所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                      |
|--------|--------------|---------------------------|
| 注册登记机构 | 兴业全球基金管理有限公司 | 上海市浦东新区张杨路 500 号时代广场 20 楼 |

## § 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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 18,687,577.17                         |
| 本期利润          | 18,687,577.17                         |
| 本期净值收益率       | 2.1836%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日)                 |
| 期末基金资产净值      | 984,314,027.98                        |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2012 年 6 月 30 日)                 |
| 累计净值收益率       | 16.6165%                              |

注：1、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。

2、本基金收益分配按月结转份额。

### 3.2 基金净值表现

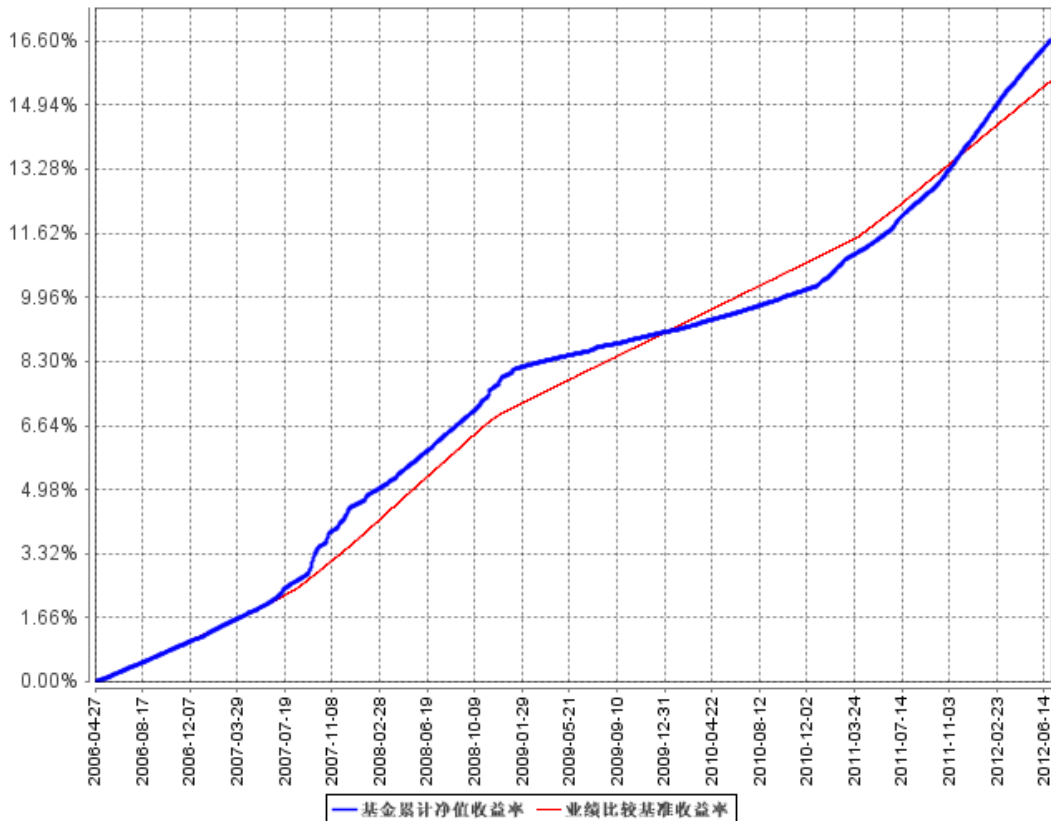
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段              | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|-----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月           | 0.3116%      | 0.0031%             | 0.2555%        | 0.0003%               | 0.0561%  | 0.0028% |
| 过去三个月           | 1.0002%      | 0.0029%             | 0.8070%        | 0.0003%               | 0.1932%  | 0.0026% |
| 过去六个月           | 2.1836%      | 0.0036%             | 1.6297%        | 0.0002%               | 0.5539%  | 0.0034% |
| 过去一年            | 4.2289%      | 0.0036%             | 3.2892%        | 0.0002%               | 0.9397%  | 0.0034% |
| 过去三年            | 7.4261%      | 0.0046%             | 7.5125%        | 0.0017%               | -0.0864% | 0.0029% |
| 自基金合同生<br>效日起至今 | 16.6165%     | 0.0060%             | 15.5555%       | 0.0019%               | 1.0610%  | 0.0041% |

注：本基金业绩比较基准为税后 6 个月银行定期存款利率，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴业全球基金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

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

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



注：1、净值表现所取数据截至到 2012 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全货币市场证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2006 年 4 月 27 日至 2006 年 10 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

## § 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

兴业全球基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经证监基金字[2003] 100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月 2 日，中国证监会批准（证监许可[2008]6 号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”，公司注册资本由 9800 万元变更为 1.2 亿元人民币。2008 年 7 月 7 日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币 1.2 亿元变更为人民币 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。

截止 2012 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十二只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）。

#### 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       |        |  |
| 张睿  | 本基金和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理 | 2012年6月29日      | -          | 7年     | 1981年生，经济学硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴业全球基金管理有限公司研究员。 |
| 李友超 | -                       | 2007年4月17日      | 2012年6月29日 | -      | -  |

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

#### 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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。



### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

## 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

报告期内，国内需求较为疲弱，经济数据持续下滑，一、二季度 GDP 分别为 8.1% 和 7.6%，趋近全年的 GDP 预期目标 7.5%；食品及非食品价格持续下降，物价水平在半年末回落至 3% 以下的水平，实际利率由负转正；货币政策调控目标逐步由控通胀转向稳增长，上半年央行采取了两次下调存款准备金率和一次非对称降息的放松政策。稳增长政策陆续出台，而力度和效果低于市场预期，尽管上半年财政政策相对积极，但经济结构转型压力、地方融资平台债务压力、商业银行的放贷意愿和放贷能力等制约了需求改善的空间；年初周期性行业经历过一轮小的补库存后重新回归去库存的过程，工业增加值、发电量、货运周转量等宏观指标趋于一致性的下滑。海外经济环境较为复杂和动荡，由希腊选举波折引发全球对欧债的避险情绪回升，进而关注西班牙银行业风险的问题，避险资金流出新兴市场 and 欧洲而流入美国，美元相对强势，大宗商品价格下跌。

报告期内资金面较去年下半年出现明显松动，央行在公开市场上主要通过正、逆回购结合来平滑市场资金，并在 2 月和 5 月各下调一次存款准备金率，以对冲外汇占款少增的影响。上半年 R007 平均水平回落至 3.6% 左右，较去年下半年平均水平下降约 60bp，短期融资券和 Shibor 各期限品种收益率下降幅度更大在 100bp 以上，因此上半年货币基金整体行业实现了较高收益。上半年我们的投资组合以基于 Shibor 定价的协议存款和优质短期融资券为主，实现组合收益和流动性的适度搭配。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为 2.1836%，同期业绩比较基准收益率为 1.6297%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年下半年，物价继续保持低位的悬念不大，不排除部分月份 CPI 回落到 2% 以下，但未来的潜在通胀压力也会影响央行的货币政策判断。经济基本上无论国内还是海外的问题都需要更长的时间来消化，三季度是国内经济能否企稳的观察期。政策层面上降息和降准仍有一定空间，预计下半年资金面仍将保持适度宽松，资金利率水平有望继续下行，而短期债券品种在经过一定的调整之后仍有较好的配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经历，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本基金自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按月结转到份额持有人的基金账户。本报告期内，本基金本报告期内向基金份额持有人分配利润 18,687,577.17 元，符合本基金基金合同的相关规定。

## § 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

本托管人依据《兴全货币市场证券投资基金基金合同》与《兴全货币市场证券投资基金托管协议》，自 2006 年 4 月 27 日起托管兴全货币市场证券投资基金（即更名后的“兴全货币市场证券投资基金”）（以下称“本基金”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：兴全货币市场证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 696,544,733.66         | 640,150,452.78           |
| 结算备付金      |         | 427,727.27             | 45,454.55                |
| 存出保证金      |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 260,146,108.15         | 229,501,620.43           |
| 其中：股票投资    |         | -                      | -                        |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | 260,146,108.15         | 229,501,620.43           |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | 20,000,000.00          | 100,000,390.00           |
| 应收证券清算款    |         | -                      | -                        |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 9,133,186.87              | 5,618,074.91                |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 10,363,190.22             | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 996,614,946.17            | 975,315,992.67              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2012年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2011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       |            | 9,599,865.60              | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 252,421.00                | 266,738.09                  |
| 应付托管费           |            | 76,491.20                 | 80,829.73                   |
| 应付销售服务费         |            | 547,173.67                | 374,244.72                  |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 10,445.97                 | 8,037.05                    |
| 应交税费            |            | -                         | -                           |
| 应付利息            |            | 2,215.74                  | -                           |
| 应付利润            |            | 1,738,660.43              | 2,301,335.74                |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 73,644.58                 | 59,000.00                   |
| 负债合计            |            | 12,300,918.19             | 3,090,185.33                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 984,314,027.98            | 972,225,807.34              |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -                         | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 984,314,027.98            | 972,225,807.34              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 996,614,946.17            | 975,315,992.67              |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 984,314,027.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目    | 附注号 | 本期<br>2012年1月1日至<br>2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至<br>2011年6月30日 |
|--------|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入   |     | 21,993,489.94                  | 4,706,025.67                        |
| 1.利息收入 |     | 20,219,770.43                  | 4,765,653.92                        |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11   | 15,431,235.84 | 2,186,400.14 |
| 债券利息收入                     |            | 3,499,231.85  | 1,048,310.18 |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -             | -            |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 1,289,302.74  | 1,530,943.60 |
| 其他利息收入                     |            | -             | -            |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 1,773,719.51  | -59,628.25   |
| 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   | 1,773,719.51  | -59,628.25   |
| 资产支持证券投资收益                 |            | -             | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14   | -             | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.15   | -             | -            |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16   | -             | -            |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -             | -            |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17   | -             | -            |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 3,305,912.77  | 1,006,295.52 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,423,384.12  | 426,562.80   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 431,328.38    | 129,261.37   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 1,078,321.28  | 323,153.67   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18   | -             | -            |
| 5. 利息支出                    |            | 276,662.15    | 45,411.22    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 276,662.15    | 45,411.22    |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19   | 96,216.84     | 81,906.46    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 18,687,577.17 | 3,699,730.15 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 18,687,577.17 | 3,699,730.15 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 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） | 972,225,807.34                        | -     | 972,225,807.34 |

|  |                                 |                |                   |
|--|---------------------------------|----------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 18,687,577.17  | 18,687,577.17     |
| 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）      | 12,088,220.64                   | -              | 12,088,220.64     |
| 其中：1.基金申购款                             | 2,130,991,005.82                | -              | 2,130,991,005.82  |
| 2.基金赎回款                                | -2,118,902,785.18               | -              | -2,118,902,785.18 |
| 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） | -                               | -18,687,577.17 | -18,687,577.17    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 984,314,027.98                  | -              | 984,314,027.98    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011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）                        | 341,974,566.51                  | -              | 341,974,566.51    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | 3,699,730.15   | 3,699,730.15      |
| 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）      | -133,254,023.22                 | -              | -133,254,023.22   |
| 其中：1.基金申购款                             | 972,023,154.82                  | -              | 972,023,154.82    |
| 2.基金赎回款                                | -1,105,277,178.04               | -              | -1,105,277,178.04 |
| 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） | -                               | -3,699,730.15  | -3,699,730.15     |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 208,720,543.29                  | -              | 208,720,543.29    |

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：

          兰荣            
基金管理公司负责人

          杨东            
主管会计工作负责人

          詹鸿飞            
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]49号文《关于同意兴业货币市场证券投资基金募集的批复》的核准,由兴业全球基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2006年4月27日正式生效,首次设立募集规模为1,729,582,293.12份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴全货币市场证券投资基金。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行存款、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。

本基金的业绩比较基准为:税后6个月银行定期存款利率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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于2012年6月30日的财务状况以及2012年上半年度的经营成果和净值变动情况。

### 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。

## 6.4.5 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

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 1. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 2. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 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<br>2012 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 6,544,733.66           |
| 定期存款           | 690,000,000.00         |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 510,000,000.00         |
| 存款期限 3-6 个月    | 180,000,000.00         |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 696,544,733.66         |



#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2012 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 | 260,146,108.15         | 261,067,000.00 | 920,891.85 | 0.0936% |
|    | 合计    | 260,146,108.15         | 261,067,000.00 | 920,891.85 | 0.0936% |

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<br>2012 年 6 月 30 日 |           |
|--------|------------------------|-----------|
|        | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 20,000,000.00          | -         |
| 合计     | 20,000,000.00          | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,834.25               |
| 应收定期存款利息   | 6,350,009.34           |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 192.50                 |
| 应收债券利息     | 2,760,867.22           |
| 应收买入返售证券利息 | 5,944.44               |
| 应收申购款利息    | 12,339.12              |
| 其他         | -                      |
| 合计         | 9,133,186.87           |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2012 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 | 10,445.97              |
| 合计          | 10,445.97              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2012 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 预提审计师费      | 24,863.02              |
| 预提信息披露费     | 39,781.56              |
| 预提账户维护费     | 9,000.00               |
| 合计          | 73,644.58              |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 972,225,807.34                        | 972,225,807.34    |
| 本期申购          | 2,130,991,005.82                      | 2,130,991,005.82  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,118,902,785.18                     | -2,118,902,785.18 |
| 本期末           | 984,314,027.98                        | 984,314,027.98    |

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 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           | 18,687,577.17 | -     | 18,687,577.17 |
| 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  | -18,687,577.17 | - | -18,687,577.17 |
| 本期末      | -              | - | -              |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |  |
|-----------|---------------------------------|--|
|           | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |  |
| 活期存款利息收入  | 269,665.82                      |  |
| 定期存款利息收入  | 15,132,881.96                   |  |
| 其他存款利息收入  | -                               |  |
| 结算备付金利息收入 | 1,682.16                        |  |
| 其他        | 27,005.90                       |  |
| 合计        | 15,431,235.84                   |  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内未进行股票买卖交易。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                              |  |
|------------------------|---------------------------------|--|
|                        | 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |  |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 518,387,154.47                  |  |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 510,413,144.73                  |  |
| 减：应收利息总额               | 6,200,290.23                    |  |
| 债券投资收益                 | 1,773,719.51                    |  |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 24,863.02                             |
| 信息披露费 | 39,781.56                             |
| 账户服务费 | 16,900.00                             |
| 银行汇划费 | 14,672.26                             |
| 合计    | 96,216.84                             |

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做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

本报告期内与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             |
|----------------------------|---------------------|
| 兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴业全球基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）     | 基金托管人、基金代销机构        |
| 兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）     | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |                | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |                |
|-------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
|       | 回购成交金额                     | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 兴业证券  | 407,600,000.00             | 100.00%        | 250,000,000.00                  | 100.00%        |

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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<br>2012年1月1日至<br>2012年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6<br>月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,423,384.12                   | 426,562.80                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 128,679.26                     | 61,447.46                           |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.33%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2012年1月1日至2012<br>年6月30日 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年<br>6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 431,328.38                     | 129,261.37                          |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 本期<br>2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |
| 兴业全球基金            | 674,989.02                 |
| 兴业证券              | 43,828.90                  |
| 兴业银行              | 132,875.97                 |

|                   |                                 |
|-------------------|---------------------------------|
| 合计                | 851,693.89                      |
| 获得销售服务费<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|                   | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 兴业全球基金            | 141,340.63                      |
| 兴业证券              | 61,389.03                       |
| 兴业银行              | 44,008.42                       |
| 合计                | 246,738.08                      |

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金销售服务费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 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

本基金本报告期内未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

本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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<br>名称 | 本期                   |              | 上年度可比期间              |            |
|-----------|----------------------|--------------|----------------------|------------|
|           | 2012年1月1日至2012年6月30日 |              | 2011年1月1日至2011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     |
| 兴业银行      | 46,544,733.66        | 1,893,705.99 | 24,652,385.50        | 276,984.17 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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

| 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 |
|---------------|---------------|-------------|---------------|----|
| 16,991,133.28 | 2,259,119.20  | -562,675.31 | 18,687,577.17 | -  |

#### 6.4.12 期末（2012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

本基金本期末未持有暂时停牌的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限证券。

##### 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 2012 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 9,854,000.00 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       |
|---------|------------|----------------|--------|---------|--------------|
| 1101096 | 11 央行票据 96 | 2012 年 7 月 4 日 | 98.54  | 100,000 | 9,854,000.00 |
| 合计      |            |                |        | 100,000 | 9,854,000.00 |

###### 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交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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等级的债券、国债、央行票据等，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在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；基金在进行银行间同业市场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。

#### 6.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本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，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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。



#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2012 年 6 月 30 日   | 1 个月以内                | 1-3 个月                | 3 个月-1 年              | 1-5 年    | 5 年<br>以上 | 不计息                   | 合计                    |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 资产                       |                       |                       |                       |          |           |                       |                       |
| 银行存款                     | 96,544,733.66         | 420,000,000.00        | 180,000,000.00        | -        | -         | -                     | 696,544,733.66        |
| 结算备付金                    | 427,727.27            | -                     | -                     | -        | -         | -                     | 427,727.27            |
| 交易性金融资产                  | -                     | 60,304,083.46         | 199,842,024.69        | -        | -         | -                     | 260,146,108.15        |
| 买入返售金融资产                 | 20,000,000.00         | -                     | -                     | -        | -         | -                     | 20,000,000.00         |
| 应收利息                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 9,133,186.87          | 9,133,186.87          |
| 应收申购款                    | 4,810,200.00          | -                     | -                     | -        | -         | 5,552,990.22          | 10,363,190.22         |
| 资产总计                     | 121,782,660.93        | 480,304,083.46        | 379,842,024.69        | -        | -         | 14,686,177.09         | 996,614,946.17        |
| 负债                       |                       |                       |                       |          |           |                       |                       |
| 卖出回购金融资产款                | 9,599,865.60          | -                     | -                     | -        | -         | -                     | 9,599,865.60          |
| 应付管理人报酬                  | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 252,421.00            | 252,421.00            |
| 应付托管费                    | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 76,491.20             | 76,491.20             |
| 应付销售服务费                  | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 547,173.67            | 547,173.67            |
| 应付交易费用                   | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 10,445.97             | 10,445.97             |
| 应付利息                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 2,215.74              | 2,215.74              |
| 应付利润                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 1,738,660.43          | 1,738,660.43          |
| 其他负债                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 73,644.58             | 73,644.58             |
| 负债总计                     | 9,599,865.60          | -                     | -                     | -        | -         | 2,701,052.59          | 12,300,918.19         |
| <b>利率敏感度缺口</b>           | <b>112,182,795.33</b> | <b>480,304,083.46</b> | <b>379,842,024.69</b> | <b>-</b> | <b>-</b>  | <b>-11,985,124.50</b> | <b>984,314,027.98</b> |
| 上年度末<br>2011 年 12 月 31 日 | 1 个月以内                | 1-3 个月                | 3 个月-1 年              | 1-5 年    | 5 年<br>以上 | 不计息                   | 合计                    |
| 资产                       |                       |                       |                       |          |           |                       |                       |
| 银行存款                     | 150,452.78            | 390,000,000.00        | 250,000,000.00        | -        | -         | -                     | 640,452,782.78        |
| 结算备付金                    | 45,454.55             | -                     | -                     | -        | -         | -                     | 45,454.55             |
| 交易性金融资产                  | -                     | 79,486,620.50         | 150,014,999.93        | -        | -         | -                     | 229,501,620.43        |
| 买入返售金融资产                 | 50,000,195.00         | 50,000,195.00         | -                     | -        | -         | -                     | 100,000,390.00        |
| 应收利息                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 5,618,074.91          | 5,618,074.91          |
| 其他资产                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | -                     | -                     |
| 资产总计                     | 50,196,102.33         | 519,486,815.50        | 400,014,999.93        | -        | -         | 5,618,074.91          | 975,315,992.67        |
| 负债                       |                       |                       |                       |          |           |                       |                       |
| 应付管理人报酬                  | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 266,738.09            | 266,738.09            |
| 应付托管费                    | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 80,829.73             | 80,829.73             |
| 应付销售服务费                  | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 374,244.72            | 374,244.72            |
| 应付交易费用                   | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 8,037.05              | 8,037.05              |
| 应付利润                     | -                     | -                     | -                     | -        | -         | 2,301,335.74          | 2,301,335.74          |

|                |                      |                       |                       |          |          |                     |                       |
|----------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|----------|----------|---------------------|-----------------------|
| 其他负债           | -                    | -                     | -                     | -        | -        | 59,000.00           | 59,000.00             |
| 负债总计           | -                    | -                     | -                     | -        | -        | 3,090,185.33        | 3,090,185.33          |
| <b>利率敏感度缺口</b> | <b>50,196,102.33</b> | <b>519,486,815.50</b> | <b>400,014,999.93</b> | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>2,527,889.58</b> | <b>972,225,807.34</b> |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                |                             |                   |
|----|--------------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动      |                             |                   |
|    | 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线） |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动                      | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                                | 本期末（2012年6月30日）             | 上年度末（2011年12月31日） |
|    | 利率 -1%                         | 1,444,773.61                | 1,265,652.66      |
|    | 利率 +1%                         | -1,425,156.52               | -1,247,370.76     |

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，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，因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

## § 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            | 260,146,108.15 | 26.10         |
|    | 其中:债券             | 260,146,108.15 | 26.10         |
|    | 资产支持证券            | -              | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 20,000,000.00  | 2.01          |
|    | 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      | 696,972,460.93 | 69.93         |
| 4  | 其他各项资产            | 19,496,377.09  | 1.96          |
| 5  | 合计                | 996,614,946.17 | 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 | 1.38           |                |
|    | 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 | 9,599,865.60   | 0.98           |
|    | 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

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 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    | 106 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 138 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 78  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过 180 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                  | 11.88               | 0.98                |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天(含)—60 天            | 37.60               | -                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.02                | -                   |
| 3  | 60 天(含)—90 天            | 11.20               | -                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天(含)—180 天           | 24.32               | -                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 180 天(含)—397 天(含)       | 14.27               | -                   |
|    | 其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                         | 99.27               | 0.98                |

### 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                 | 49,268,810.86  | 5.01          |
| 3  | 金融债券                 | 10,080,880.36  | 1.02          |
|    | 其中: 政策性金融债           | 10,080,880.36  | 1.02          |
| 4  | 企业债券                 | -              | -             |
| 5  | 企业短期融资券              | 200,796,416.93 | 20.40         |
| 6  | 中期票据                 | -              | -             |
| 7  | 其他                   | -              | -             |
| 8  | 合计                   | 260,146,108.15 | 26.43         |
| 9  | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 10,080,880.36  | 1.02          |

### 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  | 1101096   | 11 央行票据 96    | 500,000 | 49,268,810.86 | 5.01          |
| 2  | 011104003 | 11 中石集 SCP003 | 400,000 | 40,064,004.55 | 4.07          |
| 3  | 041259025 | 12 蓝天 CP001   | 200,000 | 20,164,575.00 | 2.05          |
| 4  | 041255013 | 12 大众 CP001   | 200,000 | 20,004,759.41 | 2.03          |
| 5  | 041256003 | 12 赣高速 CP001  | 200,000 | 20,000,416.07 | 2.03          |
| 6  | 041259032 | 12 川交投 CP001  | 200,000 | 19,983,687.38 | 2.03          |

|    |           |              |         |               |      |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|------|
| 7  | 041259011 | 12 浙国贸 CP001 | 100,000 | 10,187,267.59 | 1.03 |
| 8  | 041159003 | 11 北电 CP001  | 100,000 | 10,159,198.55 | 1.03 |
| 9  | 041259004 | 12 闽能源 CP001 | 100,000 | 10,115,321.51 | 1.03 |
| 10 | 041161007 | 11 中电投 CP005 | 100,000 | 10,110,825.09 | 1.03 |

## 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                   | 0.1852% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0375% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0802% |

## 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 本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照实际利率每日计提应收利息，2007 年 7 月 1 日前按直线法，2007 年 7 月 1 日起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。
- 7.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

## 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    | 9,133,186.87  |
| 4  | 应收申购款   | 10,363,190.22 |
| 5  | 其他应收款   | -             |
| 6  | 待摊费用    | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 19,496,377.09 |

### 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 |
| 8,039    | 122,442.35 | 648,483,409.83 | 65.88% | 335,830,618.15 | 34.12% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                | 持有份额总数(份)     | 占基金总份额比例 |
|-------------------|---------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 15,597,761.71 | 1.5846%  |

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 100 万份以上。

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

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 972,225,807.34   |
| 本报告期基金总申购份额   | 2,130,991,005.82 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,118,902,785.18 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 984,314,027.98   |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开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

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动：

经中国证监会批准，王晓明先生任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、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

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

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——安永华明会计师事务所。

### 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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 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 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

#### 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 | -    | -            | 407,600,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内未发生偏离度绝对值超过 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  | 关于旗下各基金 2011 年 12 月 31 日资产净值公告    | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 1 月 1 日  |
| 2  | 关于兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2012 年第 1 号） | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 1 月 10 日 |
| 3  | 关于兴全货币市场基金“春节”假期前暂停接受申购和转换转入申请的公告 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 1 月 16 日 |
| 4  | 关于兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2012 年第 2 号） | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 2 月 10 日 |
| 5  | 关于在中信金通证券开通旗下部分基金代销业务的公告          | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 2 月 11 日 |
| 6  | 关于调整中国工商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告        | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 2 月 27 日 |
| 7  | 关于聘任公司高级管理人员的公告                   | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 3 月 6 日  |
| 8  | 关于兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2012 年第 3 号） | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 3 月 12 日 |
| 9  | 关于兴全货币市场基金“清明”假期前暂停接受申购和转换转入申请的公告 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 3 月 26 日 |
| 10 | 关于兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2012 年第 4 号） | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 4 月 10 日 |
| 11 | 关于兴全货币市场基金“五一”假期前暂停接受申购和转换转入申请的公告 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 4 月 23 日 |
| 12 | 关于兴全货币市场证券投资基                     | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 5 月 10 日 |



|    |                                   |               |                 |
|----|-----------------------------------|---------------|-----------------|
|    | 金收益支付公告（2012 年第 5 号）              |               |                 |
| 13 | 关于增加渤海证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告    | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 5 月 21 日 |
| 14 | 关于深圳分公司成立的公告                      | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 5 月 23 日 |
| 15 | 关于在天相投顾开通旗下基金定期定额投资业务的公告          | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 6 月 4 日  |
| 16 | 关于增加众禄基金为旗下部分基金代销机构的公告            | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 6 月 8 日  |
| 17 | 关于兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2012 年第 6 号） | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 6 月 11 日 |
| 18 | 关于兴全货币市场基金“端午”假期前暂停接受申购和转换转入申请的公告 | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 6 月 16 日 |
| 19 | 关于兴全货币市场证券投资基金基金经理变更的公告           | 中国证券报、基金管理人网站 | 2012 年 6 月 30 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全货币市场证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全货币市场证券投资基金更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xyfunds.com.cn>) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴业全球基金管理有限公司

2012 年 8 月 24 日