

# 兴全货币市场证券投资基金

## 2014 年年度报告

2014 年 12 月 31 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：2015 年 3 月 27 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 2015 年 3 月 25 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。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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 .....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§6 审计报告.....</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>14</b>
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 债券回购融资情况.....	37
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
8.5 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 .....	39
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	40
8.7 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 .....	40
8.8 投资组合报告附注.....	40
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
9.3 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>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	42
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
11.4 基金投资策略的改变.....	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	43
11.9 其他重大事件.....	44
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>45</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
13.1 备查文件目录.....	45
13.2 存放地点.....	45
13.3 查阅方式.....	46

## § 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	717,012,329.48 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	021-20398888	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		021-20398858	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 19-20 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>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	47,259,563.22	53,750,350.32	33,209,614.24
本期利润	47,259,563.22	53,750,350.32	33,209,614.24
本期净值收益率	4.7282%	3.9406%	3.8546%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末基金资产净值	717,012,329.48	1,778,060,566.67	731,974,057.16
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
累计净值收益率	29.0182%	23.1938%	18.5236%

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

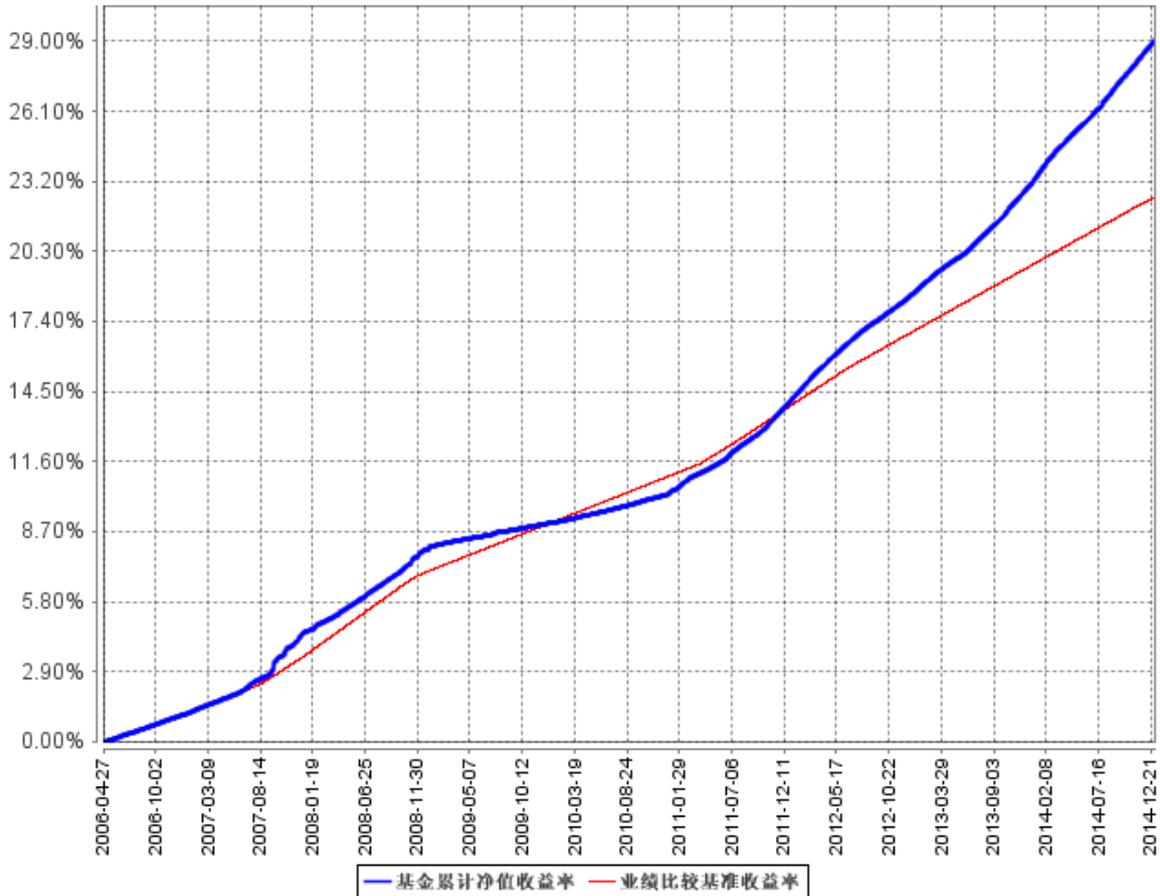
#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.1813%	0.0049%	0.6784%	0.0003%	0.5029%	0.0046%
过去六个月	2.4242%	0.0076%	1.3841%	0.0003%	1.0401%	0.0073%
过去一年	4.7282%	0.0061%	2.7726%	0.0002%	1.9556%	0.0059%
过去三年	13.0504%	0.0047%	8.6173%	0.0005%	4.4331%	0.0042%
过去五年	18.3011%	0.0051%	13.5019%	0.0013%	4.7992%	0.0038%
自基金合同 生效起至今	29.0182%	0.0060%	22.5430%	0.0017%	6.4752%	0.0043%

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收益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

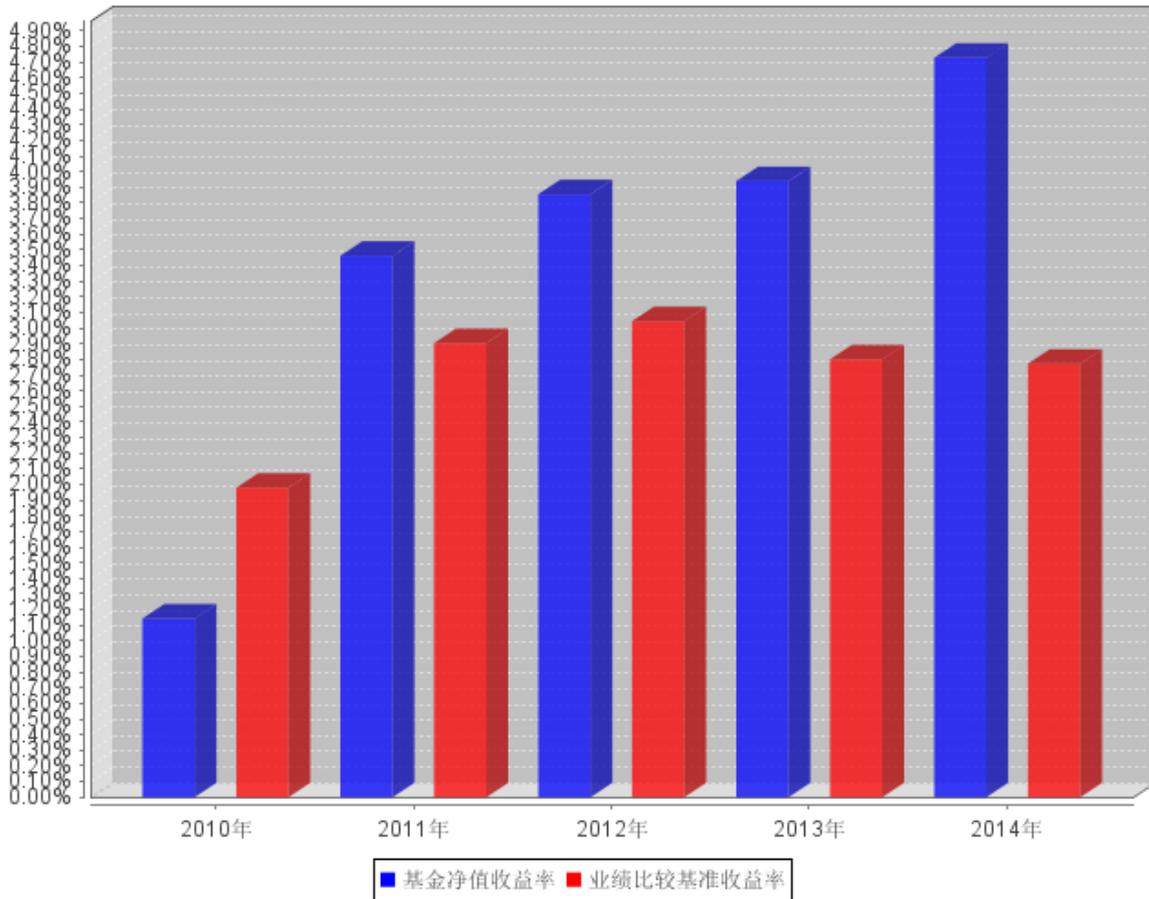


注：1、净值表现所取数据截至到 2014 年 12 月 31 日。

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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2014	40,978,304.53	7,936,691.42	-1,655,432.73	47,259,563.22	
2013	46,655,060.34	5,352,983.34	1,742,306.64	53,750,350.32	
2012	29,688,232.75	4,339,661.67	-818,280.18	33,209,614.24	
合计	117,321,597.62	17,629,336.43	-731,406.27	134,219,527.78	

## § 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是经中国证监会（证监基字[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”。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。

截止 2014 年 12 月 31 日，公司旗下管理着十四只基金，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）、兴全商业模式优选股票型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨云	固定收益部总监、本基金、兴全可转债混合型证券投资基金和兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2014 年 6 月 10 日	-	12 年	理学硕士，历任申银万国证券研究所金融工程部、策略部研究员；兴全可转债混合型证券投资基金的基金经理助理、兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴业全球基金管理有限公司公平交易制度》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

经历了 2013 年的“钱荒”，2014 年迎来了一轮波澜壮阔的牛市行情，2014 年 GDP 增速进一步下行至 7.4%，工业增加值在 2014 年 11 月曾创下同比增速为 7.2%的阶段新低，固定资产投资完成额累计同比增速 12 月跌至 15.7%，再创 2001 年 12 月以来的新低，全年 CPI 和 PPI 都处于低位运行。经济基本面的下滑，使得市场不断加码对央行实施宽松货币政策的预期，全年 1Y 至 10Y 各期限国债较去年末均有 100 个基点左右的下行，年末固定利率企业债券加权平均发行利率为 5.52%，较去年末下降 148 个基点。

本基金去年 8 月份起停止了大额申购，适时大举提高了现券配置力度，抓住了去年 8、9 月份以来收益率一波凌厉的下行机会，调整策略适当杠杆运作并拉长久期，力争在超越基准收益的同时降低收益率的波动性。

#### 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 4.7282%，同期业绩比较基准收益率 2.7726%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年经济增速或进一步下滑，CPI 仍维持低位，稳健的货币政策将不会发生根本性的转向，然总量控制，结构化宽松的取向并不会发生明显的变化。社会融资成本不降，短端利率没有实质性下行，收益率曲线的过分平坦甚至倒挂，与其说是市场对宽松预期充分，不如说是尚未有实质性的宽松。然而，在经济下行，债务存量仍然不能停止扩张的脚步，如果货币市场利率没有切实的下降，实体经济要看到真正的企稳和复苏是有难度的。因而，在现阶段不论是经济基本面，还是倒逼出来的政策面仍然会对 2015 年的债市构成一定支撑，审时度势适当拉长久期运作，市场利率波幅随着资金面的变化或有适当想象空间，配合部分交易盘运作的同时仍然警惕信用风险。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》

以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 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遵规守信、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；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2015）审字第 60467611_B03 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的兴全货币市场证券投资基金财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人兴业全球基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编

	制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了兴全货币市场证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	中国注册会计师边卓群   中国注册会计师蒋燕华
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2015 年 3 月 24 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	500,252,419.94	1,052,375,455.44
结算备付金		-	95,238.10

存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	270,817,513.42	539,649,459.78
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		270,817,513.42	539,649,459.78
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	30,000,245.00	568,300,133.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	9,168,419.27	12,693,738.77
应收股利		-	-
应收申购款		33,114,119.17	3,510,110.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		843,352,716.80	2,176,624,135.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		121,999,417.00	-
应付证券清算款		-	394,300,000.00
应付赎回款		2,309,699.71	128,470.23
应付管理人报酬		170,103.39	362,942.12
应付托管费		51,546.51	109,982.47
应付销售服务费		128,866.23	274,956.16
应付交易费用	7.4.7.7	24,834.07	22,241.81
应交税费		-	-
应付利息		20,557.33	-
应付利润		1,569,929.47	3,225,362.20
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	65,433.61	139,614.02
负债合计		126,340,387.32	398,563,569.01
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	717,012,329.48	1,778,060,566.67
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		717,012,329.48	1,778,060,566.67
负债和所有者权益总计		843,352,716.80	2,176,624,135.68

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 717,012,329.48 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		56,296,272.14	63,926,296.67
1.利息收入		50,019,018.07	59,934,626.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	35,003,556.67	41,520,312.47
债券利息收入		13,212,113.79	14,180,707.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,803,347.61	4,233,606.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,277,254.07	3,974,971.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	6,277,254.07	3,974,971.68
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	16,698.43
<b>减：二、费用</b>		9,036,708.92	10,175,946.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,529,743.48	4,465,426.31
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,069,619.28	1,353,159.53
3. 销售服务费		2,674,048.18	3,382,898.71
4. 交易费用	7.4.7.19	12.50	-
5. 利息支出		1,558,926.64	757,338.75
其中：卖出回购金融资产支出		1,558,926.64	757,338.75
6. 其他费用	7.4.7.20	204,358.84	217,123.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		47,259,563.22	53,750,350.32
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		47,259,563.22	53,750,350.32

### 7.3 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	1,778,060,566.67	-	1,778,060,566.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,259,563.22	47,259,563.22
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）	-1,061,048,237.19	-	-1,061,048,237.19
其中：1. 基金申购款	8,865,402,420.29	-	8,865,402,420.29
2. 基金赎回款	-9,926,450,657.48	-	-9,926,450,657.48
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）	-	-47,259,563.22	-47,259,563.22
五、期末所有者权益（基金净值）	717,012,329.48	-	717,012,329.48
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	731,974,057.16	-	731,974,057.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	53,750,350.32	53,750,350.32
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）	1,046,086,509.51	-	1,046,086,509.51
其中：1. 基金申购款	9,952,177,252.94	-	9,952,177,252.94
2. 基金赎回款	-8,906,090,743.43	-	-8,906,090,743.43
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）	-	-53,750,350.32	-53,750,350.32

填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,778,060,566.67	-	1,778,060,566.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_兰荣\_\_\_\_\_杨东\_\_\_\_\_詹鸿飞\_\_\_\_\_  
基金管理人负责人                主管会计工作负责人                会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全货币市场证券投资基金（原名兴业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基金管理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。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

### 7.4.3 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易类金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### 1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

##### 2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### 3) 回购协议

(1) 基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

##### 4) 其他

(1) 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；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标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，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5% 的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

-

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同

利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) “每日分配、按月支付”。本基金的基金份额采用人民币 1.00 元的固定份额净值交易方式，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，并按月结转到投资者基金账户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元；基金投资当期亏损时，相应调减持有人持有份额，基金份额净值始终为 1.00 元；

(2) 本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配到投资者收益账户。每月累计收益只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式结转为基金份额，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减投资者基金份额。若投资者赎回时，收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除；

(3) 本基金的基金合同生效后，每月集中结转当前累计收益，基金合同生效不满一个月不结转。本基金收益结转时以截尾的方式保留小数点后两位。因截尾形成的余额归入基金财产，参与第二个工作日的分配；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 当日申购的基金份额不享有当日分红权益；当日赎回的基金份额享有当日分红权益；

(6) 在符合相关法律、法规及规范性文件的规定，并且不影响投资者利益情况下，经与基金托

管人协商一致并得到批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过；

(7)法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策变更的说明在 7.4.2 会计报表的编制基础中披露。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 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。

#### 7.4.6.2 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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利

息所得有关个人所得税政策的通知》的规定：自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	5,252,419.94	422,375,455.44
定期存款	495,000,000.00	630,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	195,000,000.00	120,000,000.00
存款期限 1 个月内	180,000,000.00	510,000,000.00
存款期限 3 个月~1 年	120,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	500,252,419.94	1,052,375,455.44

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 12 月 31 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	270,817,513.42	270,581,000.00	-236,513.42	-0.0330%
	合计	270,817,513.42	270,581,000.00	-236,513.42	-0.0330%
项目		上年度末 2013 年 12 月 31 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	539,649,459.78	539,015,000.00	-634,459.78	-0.0357%
	合计	539,649,459.78	539,015,000.00	-634,459.78	-0.0357%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	30,000,245.00	-
买入返售证券_交易所	-	-
合计	30,000,245.00	-
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	9,000,133.50	-
买入返售证券_交易所	559,300,000.00	-
合计	568,300,133.50	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,604.21	31,365.31
应收定期存款利息	3,141,643.21	1,614,741.69
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	47.19
应收债券利息	5,910,064.64	10,941,274.03
应收买入返售证券利息	103,454.40	45,199.12
应收申购款利息	10,652.81	61,111.43
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	9,168,419.27	12,693,738.77

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	24,834.07	22,241.81
合计	24,834.07	22,241.81

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	-	-
应付转换费	6,433.61	614.02
审计师费	50,000.00	50,000.00
账户服务费	4,500.00	4,500.00
上清所账户服务费	4,500.00	4,500.00
信息披露费	-	80,000.00
合计	65,433.61	139,614.02

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,778,060,566.67	1,778,060,566.67
本期申购	8,865,402,420.29	8,865,402,420.29
本期赎回(以“-”号填列)	-9,926,450,657.48	-9,926,450,657.48
本期末	717,012,329.48	717,012,329.48

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	47,259,563.22	-	47,259,563.22

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	-47,259,563.22	-	-47,259,563.22
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
活期存款利息收入	371,452.50	705,282.22
定期存款利息收入	34,539,904.53	40,742,847.81
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	7,798.83	11,071.01
其他	84,400.81	61,111.43
合计	35,003,556.67	41,520,312.47

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未进行股票买卖交易。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31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	6,277,254.07	3,974,971.68
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	6,277,254.07	3,974,971.68

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	1,647,579,122.30	1,306,021,291.04
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	1,606,133,141.82	1,280,025,755.77
减：应收利息总额	35,168,726.41	22,020,563.59
买卖债券差价收入	6,277,254.07	3,974,971.68

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期末及上年度末均不存在公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	16,698.43
合计	-	16,698.43

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	12.50	-
合计	12.50	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	70,000.00	80,000.00
账户服务费	36,400.00	36,400.00
银行费用	47,708.84	50,723.05
其他	250.00	-
合计	204,358.84	217,123.05

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
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
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司（以下简称“兴全睿众”）	基金管理人控制的公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	528,000,000.00	100.00%	2,028,800,000.00	100.00%

###### 7.4.10.1.3 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
当期发生的基金应支付 的管理费	3,529,743.48	4,465,426.31
其中：支付销售机构的 客户维护费	292,690.77	224,225.95

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31 日
当期发生的基金应支付 的托管费	1,069,619.28	1,353,159.53

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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业全球基金管理有限公司	1,856,270.06
兴业证券	110,833.69
兴业银行	129,913.81
合计	2,097,017.56
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业全球基金管理有限公司	2,677,489.25
兴业证券	72,140.47
兴业银行	191,277.87
合计	2,940,907.59

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
	期初持有的基金份额	50,097,419.20
期间申购/买入总份额	367,628,720.32	158,097,419.20
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	417,500,000.00	108,000,000.00
期末持有的基金份额	226,139.52	50,097,419.20
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.03%	2.82%

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
兴全睿众	112,258.15	0.0200%	34,054.68	0.0000%

#### 7.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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	35,252,419.94	3,245,508.09	452,375,455.44	13,251,791.56

注：当期利息收入包括活期存款利息收入人民币 371,452.50 元和定期存款利息收入人民币 2,874,055.59 元。

#### 7.4.10.6 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均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 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
40,978,304.53	7,936,691.42	-1,655,432.73	47,259,563.22	-

#### 7.4.12 ( 2014 年 12 月 31 日 ) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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认购新发或增发证券。

### 7.4.12.2 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暂时停牌股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 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金融资产款余额 121, 999, 417. 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
041451028	14 浙商集 CP001	2015 年 1 月 5 日	100. 61	200, 000	20, 122, 212. 85
041453073	14 长电科技 CP001	2015 年 1 月 5 日	100. 87	50, 000	5, 043, 644. 59
041453118	14 酒钢 CP002	2015 年 1 月 5 日	100. 01	300, 000	30, 002, 501. 95
041460066	14 两面针 CP001	2015 年 1 月 5 日	100. 52	100, 000	10, 051, 687. 54
041462048	14 金鸿 CP002	2015 年 1 月 5 日	100. 00	200, 000	20, 000, 130. 03
041471011	14 苏交科 CP001	2015 年 1 月 5 日	99. 96	100, 000	9, 996, 098. 28
140207	14 国开 07	2015 年 1 月 6 日	100. 15	100, 000	10, 014, 738. 34
140430	14 农发 30	2015 年 1 月 6 日	100. 23	200, 000	20, 046, 928. 03
合计				1, 250, 000	125, 277, 941. 61

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场正回购抵押债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5	5 年	不计息	合计
-----	--------	--------	----------	-----	-----	-----	----



2014 年 12 月 31 日				年	以上		
资产							
银行存款	185,252,419.94	195,000,000.00	120,000,000.00	-	-	-	500,252,419.94
交易性金融资产	10,120,022.44	40,197,401.21	220,500,089.77	-	-	-	270,817,513.42
买入返售金融资产	30,000,245.00	-	-	-	-	-	30,000,245.00
应收利息	-	-	-	-	-	9,168,419.27	9,168,419.27
应收申购款	2,524,422.30	-	-	-	-	30,589,696.87	33,114,119.17
资产总计	227,897,109.68	235,197,401.21	340,500,089.77	-	-	39,758,116.14	843,352,716.80
负债							
卖出回购金融资产款	121,999,417.00	-	-	-	-	-	121,999,417.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,309,699.71	2,309,699.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	170,103.39	170,103.39
应付托管费	-	-	-	-	-	51,546.51	51,546.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	128,866.23	128,866.23
应付交易费用	-	-	-	-	-	24,834.07	24,834.07
应付利息	-	-	-	-	-	20,557.33	20,557.33
应付利润	-	-	-	-	-	1,569,929.47	1,569,929.47
其他负债	-	-	-	-	-	65,433.61	65,433.61
负债总计	121,999,417.00	-	-	-	-	4,340,970.32	126,340,387.32
利率敏感度缺口	105,897,692.68	235,197,401.21	340,500,089.77	-	-	35,417,145.82	717,012,329.48
上年度末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2013 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	1,002,375,455.44	50,000,000.00	-	-	-	-	1,052,375,455.44
结算备付金	95,238.10	-	-	-	-	-	95,238.10
交易性金融资产	69,985,574.72	169,941,420.36	299,722,464.70	-	-	-	539,649,459.78
买入返售金融资产	568,300,133.50	-	-	-	-	-	568,300,133.50
应收利息	-	-	-	-	-	12,693,738.77	12,693,738.77
应收申购款	2,192,373.91	-	-	-	-	1,317,736.18	3,510,110.09
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,642,948,775.67	219,941,420.36	299,722,464.70	-	-	14,011,474.95	2,176,624,135.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	394,300,000.00	394,300,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	128,470.23	128,470.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	362,942.12	362,942.12
应付托管费	-	-	-	-	-	109,982.47	109,982.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	274,956.16	274,956.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	22,241.81	22,241.81
应付利润	-	-	-	-	-	3,225,362.20	3,225,362.20
其他负债	-	-	-	-	-	139,614.02	139,614.02
负债总计	-	-	-	-	-	398,563,569.01	398,563,569.01
利率敏感度缺口	1,642,948,775.67	219,941,420.36	299,722,464.70	-	-	-384,552,094.06	1,778,060,566.67

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2014年12月31日）	上年度末（2013年12月31日）
	利率 +1%	-1,360,968.01	-1,478,125.69
	利率 -1%	1,378,585.97	1,490,489.49

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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限

不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 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属于第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 270,817,513.42 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2013 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 539,649,459.78 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的已公允价值计量且起变动计入当期损益的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	270,817,513.42	32.11
	其中：债券	270,817,513.42	32.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	30,000,245.00	3.56
	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	500,252,419.94	59.32
4	其他各项资产	42,282,538.44	5.01
5	合计	843,352,716.80	100.00

### 8.2 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	5.07	
	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	121,999,417.00	17.01
	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

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	2014 年 1 月 9 日	21.27	发生巨额赎回	2014-01-10
2	2014 年 6 月 19 日	44.09	发生巨额赎回	2014-06-26
3	2014 年 6 月 20 日	43.98	被动超标调整期	2014-06-26
4	2014 年 6 月 23 日	38.07	被动超标调整期	2014-06-26
5	2014 年 6 月 24 日	22.68	被动超标调整期	2014-06-26
6	2014 年 6 月 25 日	21.48	被动超标调整期	2014-06-26
7	2014 年 7 月 1 日	32.04	发生巨额赎回	2014-07-02
8	2014 年 7 月 23 日	20.02	发生巨额赎回	2014-07-30
9	2014 年 7 月 24 日	20.07	发生巨额赎回	2014-07-30
10	2014 年 7 月 25 日	20.23	发生巨额赎回	2014-07-30
11	2014 年 7 月 28 日	20.27	发生巨额赎回	2014-07-30
12	2014 年 7 月 29 日	21.53	发生巨额赎回	2014-07-30

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	126
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	166
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

#### 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。

#### 8.3.2 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	27.25	17.01

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	7.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	27.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	15.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	33.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		111.72	17.01

#### 8.4 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	30,061,666.37	4.19
	其中：政策性金融债	30,061,666.37	4.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,755,847.05	33.58
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	270,817,513.42	37.77
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.5 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	041453118	14 酒钢 CP002	300,000	30,002,501.95	4.18
2	041451028	14 浙商集 CP001	200,000	20,122,212.85	2.81
3	140430	14 农发 30	200,000	20,046,928.03	2.80
4	011415005	14 中铝业 SCP005	200,000	20,002,602.49	2.79

5	041462048	14 金鸿 CP002	200,000	20,000,130.03	2.79
6	041456041	14 龙岩工贸 CP002	200,000	19,988,768.18	2.79
7	011474007	14 陕煤化 SCP007	200,000	19,981,055.19	2.79
8	041460009	14 三安 CP001	100,000	10,131,151.40	1.41
9	041466001	14 铁汉生态 CP001	100,000	10,120,022.44	1.41
10	041461035	14 绍兴城投 CP002	100,000	10,092,616.52	1.41

## 8.6 “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	0.2303%
报告期内偏离度的最低值	-0.1452%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1060%

## 8.7 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。

## 8.8 投资组合报告附注

### 8.8.1

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。

### 8.8.2

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。

**8.8.3** 本报告期内无需说明的证券投资决策程序，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查。

### 8.8.4 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	9,168,419.27
4	应收申购款	33,114,119.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	42,282,538.44

### 8.8.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
13,912	51,539.13	29,649,765.31	4.14%	687,362,564.17	95.86%

### 9.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,659,630.70	0.3709%

### 9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年4月27日）基金份额总额	1,729,582,293.12
本报告期期初基金份额总额	1,778,060,566.67
本报告期基金总申购份额	8,865,402,420.29
减:本报告期基金总赎回份额	9,926,450,657.48
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	717,012,329.48

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

2014年2月27日公告，公司副总经理王晓明于2014年2月26日起离任；

2014年3月20日公告，公司独立董事欧阳辉先生任职，独立董事吴雅伦先生离任；

2014年9月24日公告，公司董事巴斯蒂安·范布伦先生（Bastiaan Van Buuren）任职，董事霍以礼先生（Elio Fattorini）离任；

2014年11月21日公告，公司选举产生第四届董事会，由以下九名董事组成：兰荣先生、张训苏先生、杨东先生、万维德先生（Marc van Weede）、巴斯蒂安·范布伦先生（Bastiaan Van Buuren）、桑德·马特曼先生（Sander Maatman）、欧阳辉先生（独立董事）、吴明先生（独立董事）、周鹤松先生（独立董事）。

(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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起连续 9 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 5 万元人民币。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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。

#### 11.7.2 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	-	-	528,000,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

## 11.9 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	旗下各基金 2013 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报	2014 年 1 月 1 日
2	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 1 号)	中国证券报	2014 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	2014 年 1 月 24 日
4	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 2 号)	中国证券报	2014 年 2 月 10 日
5	关于增加和讯信息科技有限公司为旗下部分 基金销售机构的公告	中国证券报	2014 年 2 月 14 日
6	关于通过和讯信息科技有限公司申购或定期 定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报	2014 年 2 月 14 日
7	关于副总经理离任的公告	中国证券报	2014 年 2 月 27 日
8	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 3 号)	中国证券报	2014 年 3 月 10 日
9	关于部分独立董事变更的公告	中国证券报	2014 年 3 月 20 日
10	关于在安信证券开通基金转换业务的公告	中国证券报	2014 年 3 月 25 日
11	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 4 号)	中国证券报	2014 年 4 月 10 日
12	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	2014 年 4 月 25 日
13	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 5 号)	中国证券报	2014 年 5 月 12 日
14	关于变更兴全货币市场证券投资基金基金 经理的公告	中国证券报	2014 年 6 月 10 日
15	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 6 号)	中国证券报	2014 年 6 月 10 日
16	关于调整部分销售渠道申购及追加申购起 点的公告	中国证券报	2014 年 6 月 27 日
17	旗下各基金 2014 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报	2014 年 7 月 1 日
18	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 7 号)	中国证券报	2014 年 7 月 10 日
19	关于兴全货币市场基金暂停接受一百万元 以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报	2014 年 7 月 30 日
20	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 8 号)	中国证券报	2014 年 8 月 11 日
21	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 9 号)	中国证券报	2014 年 9 月 10 日
22	关于部分董事变更的公告	中国证券报	2014 年 9 月 24 日
23	关于兴全货币市场基金“国庆”假期前暂停 接受申购和转换转入申请的公告	中国证券报	2014 年 9 月 25 日

24	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 10 号)	中国证券报	2014 年 10 月 10 日
25	关于增加国都证券有限责任公司为旗下部分 基金销售机构的公告	中国证券报	2014 年 10 月 24 日
26	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 11 号)	中国证券报	2014 年 11 月 10 日
27	关于董事会换届的公告	中国证券报	2014 年 11 月 21 日
28	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告 (2014 年第 12 号)	中国证券报	2014 年 12 月 10 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 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

2015 年 3 月 27 日