

兴全货币市场证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：2016 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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
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 其他指标.....	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	31
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	32
7.6 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	32
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	33
7.8 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	33
7.9 投资组合报告附注.....	33
§8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	34
8.4 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	34
§9 开放式基金份额变动	35
§10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
10.4 基金投资策略的改变.....	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	36
10.9 其他重大事件.....	36
§11 影响投资者决策的其他重要信息	38
§12 备查文件目录	38
12.1 备查文件目录.....	38
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

§ 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
场内简称	-
基金主代码	340005
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	2,565,632,968.18 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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	庄园芳	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	http://www.xyfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 19-20 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	34,567,142.13
本期利润	34,567,142.13
本期净值收益率	1.5115%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	2,565,632,968.18
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	36.3897%

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

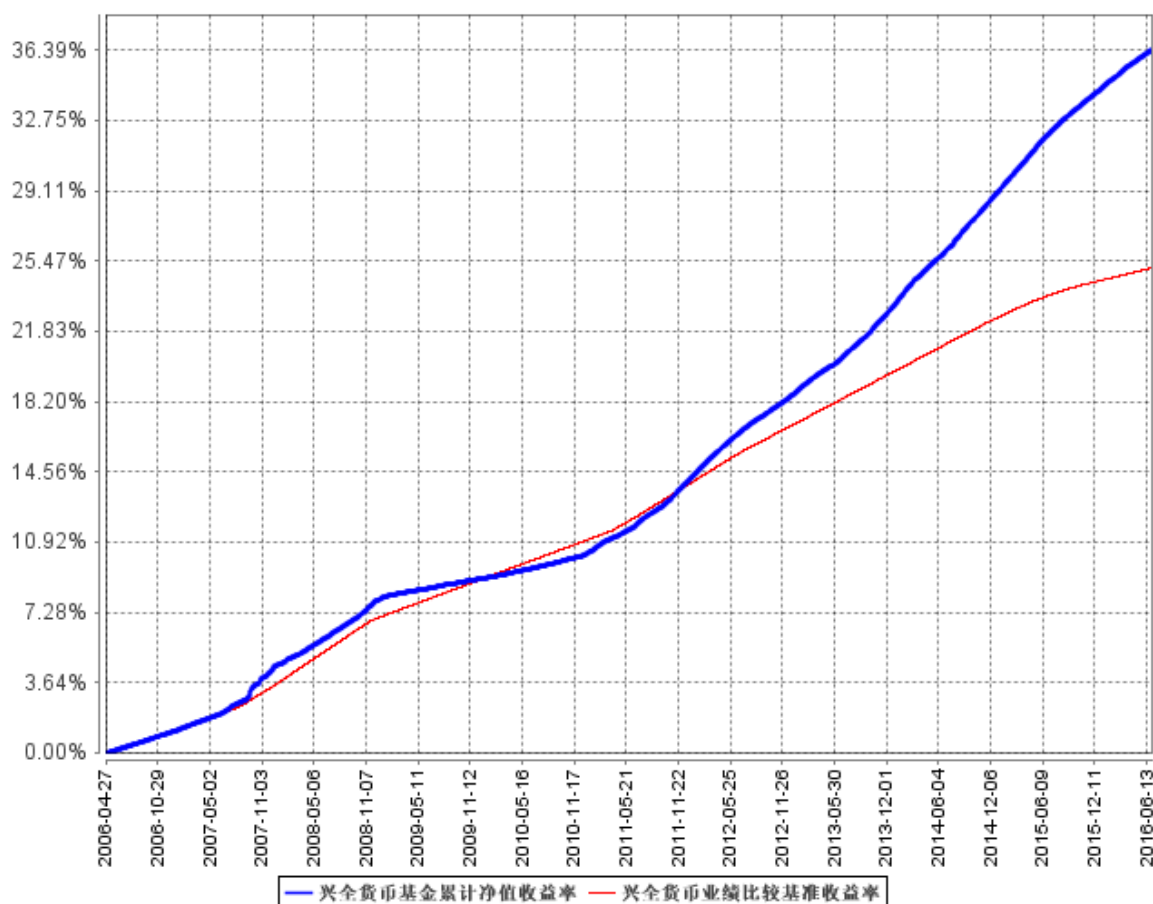
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.2262%	0.0016%	0.1068%	0.0000%	0.1194%	0.0016%
过去三个月	0.6834%	0.0020%	0.3241%	0.0000%	0.3593%	0.0020%
过去六个月	1.5115%	0.0039%	0.6482%	0.0000%	0.8633%	0.0039%
过去一年	3.2989%	0.0043%	1.4207%	0.0005%	1.8782%	0.0038%
过去三年	13.1792%	0.0052%	6.7488%	0.0017%	6.4304%	0.0035%
自基金合同 生效起至今	36.3897%	0.0059%	25.1077%	0.0018%	11.2820%	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收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全货币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 2016 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。

3.3 其他指标

无。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十七只基金，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、兴全社会责任混合型证券投资基金、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、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

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		
钟明	固定收益部总监助理兼本基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全稳益债券型证券投资基金和兴全天添益货币市场基金基金经理	2015 年 6 月 30 日	-	11 年	工商管理硕士，历任兴业全球基金管理有限公司基金会计、交易员、基金经理助理。
谢芝兰	本基金基金经理	2016 年 4 月 22 日	-	4 年	经济学硕士。历任信诚基金管理有限公司交易员，兴业全球基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。

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

在经济下行风险加大及结构性失衡问题凸显的双重压力下，政策层面也较为矛盾和纠结，一季度刺激需求托底经济意图明显，信贷投放超预期大幅增加，基建及房地产市场迎来开门红。但在权威人士再谈经济确立总体 L 型走势，并提出稳经济仍依赖基建投资拉动，而民间投资大幅下降、房地产泡沫、过剩产能等结构性矛盾没根本解决，提出坚定不移以推进供给侧结构性改革为主线，全面落实“去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板”五大重点任务，二季度开始经济、金融数据及房地产市场均出现明显回落。面临上述经济压力及政策两难的境地，加上信用违约事件的频发，上半年债市情绪上也较为谨慎和纠结，对各类扰动因素的敏感度大幅提升，利率债收益率整体呈现震荡中下行行情，信用债在利差低位经历快速大幅调整后在追逐收益的配置压力下也很快完全恢复。货币政策方面，央行保持流动性合理充裕基调未变，对资金面关键扰动时点的维稳更加及时，且随着天气回暖及英国脱欧，上半年人民币汇率及通胀对货币政策的制约效应呈逐渐减弱趋势，货币政策的灵活性增强。本基金在流动性安排上着重抓住资金面波动带来的配置

机会，并维持适度杠杆增强收益，债券配置上注重个券信用资质分析及利差保护，较好的把握了收益率调整的机会。

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 1.5115%，同期业绩比较基准收益率 0.6482%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，根据近期各项经济金融工作会议基调及发言内容来看，供给侧结构性改革、国企改革及债务重组等将在下半年作为重要工作继续加强推进，因此经济基本面难言企稳回升，将延续疲弱态势，支撑债市长期向好趋势。货币政策方面，央行将继续保持稳健灵活，进一步宽松概率不大，可能更多的转向财政刺激托底经济。全球经济发展不确定性较大，金融不稳定性风险增加，下半年全球流动性环境有望进一步放松，加上各项重大会议将在中国召开，维稳动力增加，人民币汇率贬值压力较上半年将明显减轻。整体长期趋势上来看，债市大幅调整压力不大，但在目前期限利差及信用利差已被极度压缩的情况下，对事件性的冲击将较为敏感，仍有短期震荡调整的压力，因此本组合在后期资产配置上以谨慎为主，积极抓住收益率调整的配置机会。

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 34,567,142.13 元，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

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：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,085,104,768.97	731,163,185.31

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,215,824,295.40	718,040,971.21
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,215,824,295.40	718,040,971.21
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	372,311,238.47	374,701,802.05
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	22,843,147.20	28,121,293.19
应收股利		-	-
应收申购款		19,009,067.28	36,426,080.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,715,092,517.32	1,888,453,332.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
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		139,499,730.25	149,999,525.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,820,147.62	5,977,906.86
应付管理人报酬		727,500.40	488,499.72
应付托管费		220,454.71	148,030.18
应付销售服务费		551,136.68	370,075.53
应付交易费用	6.4.7.7	42,486.63	54,891.29
应交税费		-	-
应付利息		8,219.34	8,611.91
应付利润		3,512,877.05	3,239,855.95
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	76,996.46	132,406.44
负债合计		149,459,549.14	160,419,802.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,565,632,968.18	1,728,033,529.75
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,565,632,968.18	1,728,033,529.75
负债和所有者权益总计		2,715,092,517.32	1,888,453,332.63

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,565,632,968.18 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		44,796,107.12	22,712,293.21
1.利息收入		41,114,682.54	20,045,634.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,099,273.96	12,395,951.24
债券利息收入		14,261,708.69	6,389,210.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,753,699.89	1,260,472.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,681,424.58	2,666,659.11
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	3,681,424.58	2,666,659.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、费用		10,228,964.99	4,024,666.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,815,912.82	1,330,733.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,156,337.26	403,252.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,890,843.02	1,008,131.43
4. 交易费用	6.4.7.19	75.00	30.00
5. 利息支出		2,257,160.33	1,175,111.12
其中：卖出回购金融资产支出		2,257,160.33	1,175,111.12
6. 其他费用	6.4.7.20	108,636.56	107,408.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,567,142.13	18,687,626.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,567,142.13	18,687,626.23

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,728,033,529.75	-	1,728,033,529.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	34,567,142.13	34,567,142.13
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）	837,599,438.43	-	837,599,438.43
其中：1.基金申购款	4,954,216,207.74	-	4,954,216,207.74
2.基金赎回款	-4,116,616,769.31	-	-4,116,616,769.31
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）	-	-34,567,142.13	-34,567,142.13
五、期末所有者权益（基金净值）	2,565,632,968.18	-	2,565,632,968.18
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	717,012,329.48	-	717,012,329.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,687,626.23	18,687,626.23
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）	393,368,761.73	-	393,368,761.73
其中：1.基金申购款	3,508,869,250.59	-	3,508,869,250.59
2.基金赎回款	-3,115,500,488.86	-	-3,115,500,488.86
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）	-	-18,687,626.23	-18,687,626.23
五、期末所有者权益（基金净值）	1,110,381,091.21	-	1,110,381,091.21

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：

<u> 庄园芳 </u>	<u> 杨东 </u>	<u> 詹鸿飞 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意兴业货币市场证券投资基金募集的批复》(证监许可[2006]49号文)的核准,由兴业全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则等相关法规和《兴业货币市场证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2006年4月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为1,729,582,293.12份基金份额。本基金的基金管理人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”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》和《兴全货币市场证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为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

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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2016年6月30日的财务状况以及2016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

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作。另，自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内将全面推开营业税改征增值税。本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收增值税和企业所得税。

(c) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

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 2016年6月30日
活期存款	5,104,768.97
定期存款	1,080,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	130,000,000.00
存款期限 1 个月内	-
存款期限 3 个月~1 年	950,000,000.00
其他存款	-
合计：	1,085,104,768.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	1,215,824,295.40	1,217,990,500.00	2,166,204.60	0.0844%
	合计	1,215,824,295.40	1,217,990,500.00	2,166,204.60	0.0844%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、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 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	372,311,238.47	-
合计	372,311,238.47	-

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,252.01
应收定期存款利息	6,108,597.25
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	15,987,075.39
应收买入返售证券利息	692,517.00
应收申购款利息	53,705.55
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	22,843,147.20

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 2016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	42,486.63
合计	42,486.63

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,810.24
预提费用	66,186.22
应付转换费	-
审计师费	-
账户服务费	-
上清所账户服务费	-

信息披露费	-
合计	76,996.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,728,033,529.75	1,728,033,529.75
本期申购	4,954,216,207.74	4,954,216,207.74
本期赎回(以“-”号填列)	-4,116,616,769.31	-4,116,616,769.31
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,565,632,968.18	2,565,632,968.18

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	34,567,142.13	-	34,567,142.13
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-34,567,142.13	-	-34,567,142.13
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	23,034,202.54
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	24,015.37
合计	23,099,273.96

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**

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,681,424.58
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	3,681,424.58

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,364,903,323.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,327,734,281.62
减：应收利息总额	33,487,617.55
买卖债券差价收入	3,681,424.58

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 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。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 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。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	75.00
合计	75.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	34,809.32
银行汇划费	33,150.34
交易费用	200.00
账户服务费	18,100.00
银行费用	-
其他	-
合计	108,636.56

6.4.7.21 分部报告

无。

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
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。

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 股票交易

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

权证不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.10.1.5 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,815,912.82	1,330,733.42
其中：支付销售机构的客户维护费	888,105.26	287,961.73

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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,156,337.26	403,252.55

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

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	534,763.78
兴业证券	257,199.47
兴业银行	107,319.30
合计	899,282.55
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业全球基金	344,205.28
兴业证券	73,249.81
兴业银行	76,518.07
合计	493,973.16

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	60,864,471.83	226,139.52
期间申购/买入总份额	54,235,297.72	1,340,063.98
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	115,099,769.55	1,566,203.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.4862%	0.1411%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016年6月30日		2015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	7,756,558.20	0.3023%	1,116,653.39	0.0101%
兴业银行	3,843,826.04	0.1498%	-	-

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	205,104,768.97	3,971,305.82	4,601,203.42	176,416.57

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
31,976,809.56	2,317,311.47	273,021.10	34,567,142.13	-

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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 2016 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 139,499,730.25 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
140201	14 国开 01	2016 年 7 月 1 日	101.62	200,000	20,323,825.64
140322	14 进出 22	2016 年 7 月 1 日	101.98	200,000	20,395,937.37
150302	15 进出 02	2016 年 7 月 1 日	100.58	500,000	50,290,034.14
160401	16 农发 01	2016 年 7 月 1 日	99.99	500,000	49,996,721.15
合计				1,400,000	141,006,518.30

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负责，并向首席执行官汇报日常行政事务。

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、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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；本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

估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	235,125,935.95	486,762,827.51
A-1 以下	-	-
未评级	410,084,654.62	70,015,463.38
合计	645,210,590.57	556,778,290.89

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	20,219,145.65	-
AAA 以下	141,063,899.24	50,525,087.40
未评级	-	-
合计	161,283,044.89	50,525,087.40

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金

所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的

债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	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
资产							
银行存款	245,104,768.97	490,000,000.00	350,000,000.00	-	-	-	1,085,104,768.97
交易性金融资产	40,013,429.14	573,767,492.08	602,043,374.18	-	-	-	1,215,824,295.40
买入返售金融资产	372,311,238.47	-	-	-	-	-	372,311,238.47
应收利息	-	-	-	-	-	22,843,147.20	22,843,147.20
应收申购款	3,129,488.36	-	-	-	-	15,879,578.92	19,009,067.28
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	660,558,924.94	1,063,767,492.08	952,043,374.18	-	-	-38,722,726.12	2,715,092,517.32
负债							
卖出回购金融资产款	139,499,730.25	-	-	-	-	-	139,499,730.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,820,147.62	4,820,147.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	727,500.40	727,500.40
应付托管费	-	-	-	-	-	220,454.71	220,454.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	551,136.68	551,136.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	42,486.63	42,486.63
应付利息	-	-	-	-	-	8,219.34	8,219.34
应付利润	-	-	-	-	-	3,512,877.05	3,512,877.05
其他负债	-	-	-	-	-	76,996.46	76,996.46
负债总计	139,499,730.25	-	-	-	-	9,959,818.89	149,459,549.14
利率敏感度缺口	521,059,194.69	1,063,767,492.08	952,043,374.18	-	-	-28,762,907.23	2,565,632,968.18
上年度末 2015 年 12 月 31 日	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
资产							
银行存款	241,163,185.31	275,000,000.00	215,000,000.00	-	-	-	731,163,185.31
交易性金融资产	80,091,743.58	221,294,274.45	416,654,953.18	-	-	-	718,040,971.21
买入返售金融资产	276,701,415.05	49,000,193.50	49,000,193.50	-	-	-	374,701,802.05
应收利息	-	-	-	-	-	-28,121,293.19	28,121,293.19
应收申购款	5,204,250.27	-	-	-	-	-31,221,830.60	36,426,080.87
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	603,160,594.21	545,294,467.95	680,655,146.68	-	-	-59,343,123.79	1,888,453,332.63
负债							
卖出回购金融资产款	149,999,525.00	-	-	-	-	-	149,999,525.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,977,906.86	5,977,906.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	488,499.72	488,499.72
应付托管费	-	-	-	-	-	148,030.18	148,030.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	370,075.53	370,075.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	54,891.29	54,891.29
应付利息	-	-	-	-	-	8,611.91	8,611.91
应付利润	-	-	-	-	-	3,239,855.95	3,239,855.95
其他负债	-	-	-	-	-	132,406.44	132,406.44
负债总计	149,999,525.00	-	-	-	-	-10,420,277.88	160,419,802.88
利率敏感度缺口	453,161,069.21	545,294,467.95	680,655,146.68	-	-	-48,922,845.91	1,728,033,529.75

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 1%	4,040,071.72	2,651,931.19
	市场利率上升 1%	-4,005,271.77	-2,624,956.71

6.4.13.4.2 外汇风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于本年末及上年末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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	1,215,824,295.40	44.78
	其中：债券	1,215,824,295.40	44.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	372,311,238.47	13.71
	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	1,085,104,768.97	39.97

4	其他各项资产	41,852,214.48	1.54
5	合计	2,715,092,517.32	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	9.24	
	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	139,499,730.25	5.44
	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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	25.62	5.44
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	21.03	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.63	-
	其中:剩余存续期超过 397 天	-	-

	天的浮动利率债		
4	90 天(含)—120 天	16.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	26.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.19	5.44

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

7.5 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	141,006,518.30	5.50
	其中：政策性金融债	141,006,518.30	5.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	645,210,590.57	25.15
6	中期票据	161,283,044.89	6.29
7	同业存单	268,324,141.64	10.46
8	其他	-	-
9	合计	1,215,824,295.40	47.39
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111690862	16 厦门银行 CD006	600,000	59,736,961.52	2.33
2	111690932	16 吉林银行 CD025	600,000	59,736,534.38	2.33
3	101358010	13 龙盛 MTN001	500,000	50,579,872.15	1.97
4	150302	15 进出 02	500,000	50,290,034.14	1.96
5	160401	16 农发 01	500,000	49,996,721.15	1.95
6	011699882	16 九州通 SCP003	500,000	49,993,561.96	1.95
7	011699748	16 人福 SCP002	500,000	49,976,291.10	1.95

8	011699479	16 川交投 SCP001	500,000	49,975,268.57	1.95
9	011699324	16 魏桥铝电 SCP003	500,000	49,965,320.65	1.95
10	111694926	16 九江银行 CD044	500,000	49,622,572.51	1.93

7.7 “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	0.2102%
报告期内偏离度的最低值	0.0394%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1230%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内本基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	22,843,147.20
4	应收申购款	19,009,067.28

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	41,852,214.48

7.9.4 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
47,661	53,830.87	235,241,167.25	9.17%	2,330,391,800.93	90.83%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

8.3 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	5,264,166.93	0.2052%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 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, 728, 033, 529. 75
本报告期基金总申购份额	4, 954, 216, 207. 74
减：本报告期基金总赎回份额	4, 116, 616, 769. 31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2, 565, 632, 968. 18

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。

2016 年 5 月 9 日公告，自 2016 年 5 月 9 日起公司董事长、法定代表人由兰荣先生变更为庄园芳女士；

2016 年 1 月 13 日公告，自 2016 年 1 月 13 日起郑文惠女士任公司副总经理。

(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——毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本基金本报告期未通过租用的证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	旗下各基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
4	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 9 日
5	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2016 年第 1 号）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 11 日
6	关于调整旗下基金在中国邮储银行定期定额申购起点金额的	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日

	公告		
7	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
8	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
9	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	2016 年 2 月 3 日
10	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2016 年第 2 号）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 2 月 15 日
11	关于调整陆金所资管基金申购金额下限的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 2 月 15 日
12	关于调整旗下基金在江南农商银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 3 月 3 日
13	关于调整旗下基金中信银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 3 月 7 日
14	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2016 年第 3 号）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 3 月 10 日
15	关于调整浙江同花顺基金销售有限公司基金申购起点金额的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 3 月 14 日
16	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2016 年第 4 号）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 11 日
17	关于调整部分基金网上直销转换优惠费率率的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 18 日
18	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	2016 年 4 月 22 日
19	关于增加办理兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式基金转换业务销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 27 日
20	关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率率的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 29 日
21	关于调整诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
22	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
23	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2016 年第 5 号）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
24	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
25	关于调整兴全货币基金在上海天天基金销售有限公司申购金	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 24 日

	额下限的公告		
26	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 3 日
27	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2016 年第 6 号）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 13 日
28	关于在上海陆金所资产管理有限公司开通旗下部分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	2016 年 6 月 17 日
29	关于调整开放式基金开户证件类型公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 21 日
30	关于调整诺亚正行申购、定投金额下限的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 日
31	关于调整众禄金融申购、定投金额下限的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 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

2016 年 8 月 24 日