

兴全货币市场证券投资基金

2016 年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	姓名	冯晓莲	张志永

人	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

2.4 信息披露方式

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

§ 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)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	2,565,632,968.18
期末基金份额净值	1.0000

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

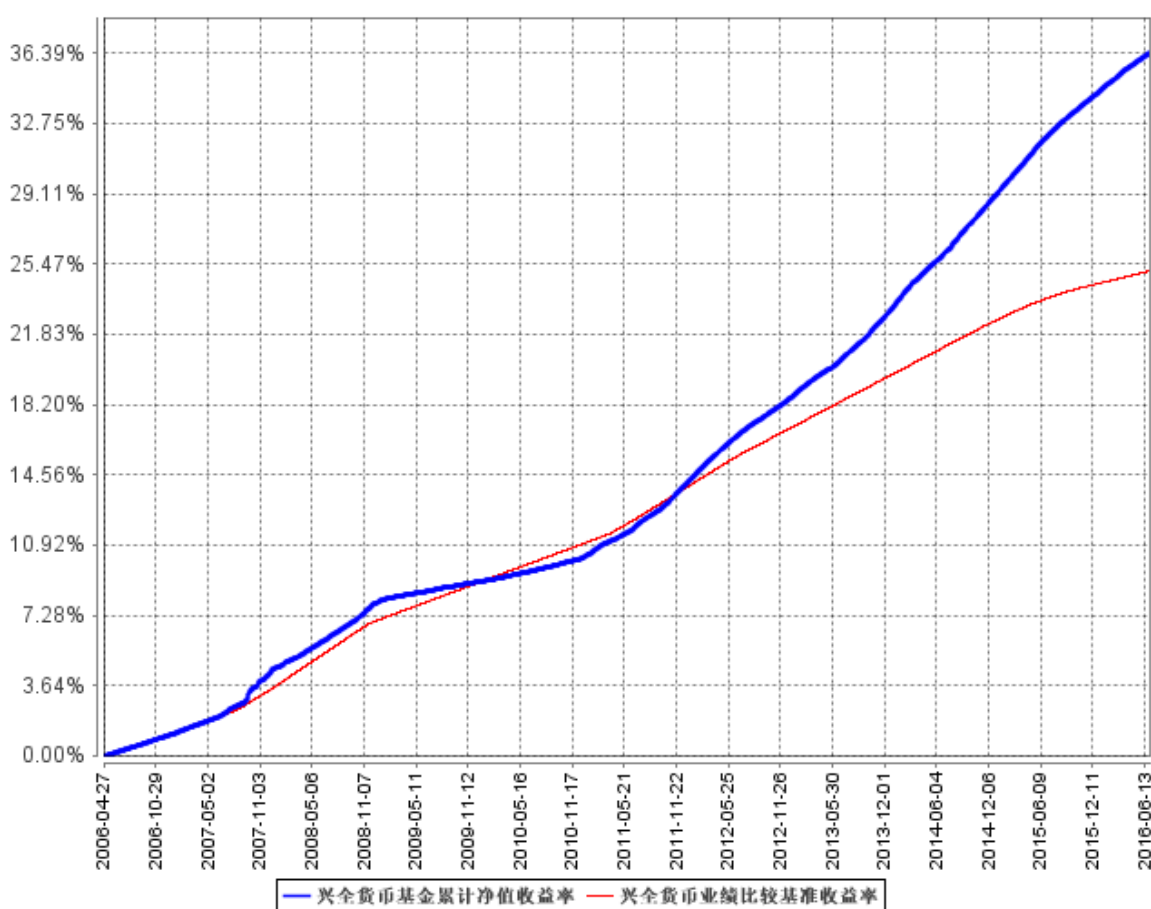
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2262%	0.0016%	0.1068%	0.0000%	0.1194%	0.0016%
过去三个月	0.6834%	0.0020%	0.3241%	0.0000%	0.3593%	0.0020%
过去六个月	1.5115%	0.0039%	0.6482%	0.0000%	0.8633%	0.0039%

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。

§ 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	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。

	兴全天添 益货币市 场基金基 金经理				
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 年以上相关工作经验，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		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		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		-	-
买入返售金融资产		372,311,238.47	374,701,802.05
应收证券清算款		-	-
应收利息		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		-	-
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		-	-
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		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		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		2,565,632,968.18	1,728,033,529.75
未分配利润		-	-
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		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		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,681,424.58	2,666,659.11
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-

股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
减：二、费用		10,228,964.99	4,024,666.98
1. 管理人报酬		3,815,912.82	1,330,733.42
2. 托管费		1,156,337.26	403,252.55
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	2,890,843.02	1,008,131.43
4. 交易费用		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		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（本期净利润）	-	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	-	-34,567,142.13	-34,567,142.13

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	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（本期净利润）	-	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：

庄园芳

基金管理人负责人

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(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 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 权证交易

权证不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
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。

6.4.8.2.3 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=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	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
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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日	上年度末 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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 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	
	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

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.9.3.1 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

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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前十名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末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

§ 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。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日