

兴全货币市场证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

汇占款的变动,因此资金利率可能在一个更小的区间内波动,但是阶段性的波动加大我们预计还会出现,我们仍将保持较恒的剩余天期,选择月末、季末等较好的配置时点加大配置力度,且在信用资质的选择上会偏向于中高级信用评级,防范低评级信用债的偿债风险。

4.6 管理人对于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、政策和程序须经估值委员会审议,并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确定后,由IT人员或IT人员协助估值系统开发并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式确保估值准确无误;4、投资人、包括基金经理、亦关注市场环境变化和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法的制定,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相关和临时信息披露。

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 管理人对于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月将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人,并按月结转给份额持有人。截至本报告期末,本基金本报告期间内基金份额持有人分配利润14,896,436.36元,符合基金基金合同的相关规定。

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约定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害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约定,对基金管理人、在本基金的投资运作、基金资产净值计算、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内容的真实性、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:2013年6月30日

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		424,576,242.81	437,239,693.94
结算备付金		1,106,818.18	500,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		401,092,727.16	310,370,738.92
其中:股票投资		-	-
基金投资		401,092,727.16	310,370,738.92
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		209,465,469.20	10,600,000.00
应收证券清算款		9,455.57	-
应收利息		9,175,703.88	5,415,092.33
应收股利		-	-
应收申购款		4,835,756.43	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,050,262,173.23	764,125,525.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		-	19,399,850.90
应付证券清算款		-	10,600,000.00
应付赎回款		262,095.64	90,565.52
应付管理人报酬		342,211.03	240,067.66
应付托管费		103,700.33	72,747.78
应付销售服务费		259,250.81	181,869.43
应付交易费用		21,354.89	13,885.90
应付税费		-	9,860.64
应付利息		2,331,100.53	1,483,055.36
递延所得税负债		-	-
其他负债		76,578.67	59,564.64
负债合计		3,396,291.90	32,151,468.03
所有者权益:			
实收基金		1,046,865,881.33	731,974,057.16
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,046,865,881.33	731,974,057.16
负债和所有者权益总计		1,050,262,173.23	764,125,525.19

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,046,865,881.33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:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013 年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012 年6月30日
一、收入		18,367,844.95	21,993,489.94
1.利息收入		16,818,224.14	20,219,770.43
其中:存款利息收入		9,622,590.21	15,431,235.84
债券利息收入		4,677,545.83	3,499,231.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,518,088.10	1,289,302.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,549,620.81	1,773,719.51
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,549,620.81	1,773,719.51
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益		-	-
利息收入		466,947.11	431,328.38
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4.交易费用		1,167,367.76	1,078,321.28
5.利息支出		193,208.05	276,662.15
其中:卖出回购金融资产支出		193,208.05	276,662.15
其他费用		102,960.28	96,216.84
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		14,896,436.36	18,687,577.17
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		14,896,436.36	18,687,577.17

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:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
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(本期净盈利)	-	14,896,436.36
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)	314,891,824.17	314,891,824.17
其中:1.基金申购款	5,039,713,476.35	5,039,713,476.35
2.基金赎回款	-4,724,821,652.18	-4,724,821,652.18
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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,046,865,881.33	1,046,865,881.33
项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
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(本期净盈利)	-	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)	-	-
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)	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	984,314,027.98	984,314,027.98

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:
兰笑 杨东 詹鸿飞
基金管理人负责人 王晋会会计工作负责人 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(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《关于同意兴全货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由兴全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。本基金为契约开放式,存续期限不定。本基金的管理人及注册登记机构为兴全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。

本基金投资目标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138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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他相关规定的声明
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2013年6月30日的财务状况以及2013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、会计估计与上一期年度报告相一致的说明
本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一期年度报告一致。

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 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
兴全全球基金管理有限公司(以下简称“兴全全球基金”)	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、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。

6.4.8 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

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
回购成交金额	896,500,000.00	407,600,000.00
占当期债券回购成交总额的比例	100.00%	100.00%

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未支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,540,925.39	1,423,384.12
其中:支付销售机构的客户维护费	101,341.61	128,679.26

注:基金管理费按前一日基金资产净值的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=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数。

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	466,947.11	431,328.38

注:基金托管费按前一日基金资产净值的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=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 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	466,947.11	431,328.38

注:基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数。

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 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	466,947.11	431,328.38

注:基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.33%÷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
6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.2 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.3 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.4 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.5 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.6 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.8 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.9 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.10 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.11 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.12 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.13 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.14 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.15 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.16 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.17 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.18 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.19 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.20 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.21 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.22 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.23 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.24 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.25 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.26 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.27 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.28 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.29 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.30 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.31 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.32 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.33 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.34 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.35 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.36 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.37 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.38 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.39 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.40 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.41 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.42 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.43 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.44 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.45 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.46 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.47 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.48 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.49 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.50 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.51 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.52 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.53 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.54 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.55 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.56 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.57 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.58 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.59 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.60 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.61 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.62 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.63 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.64 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.65 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.66 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.67 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.68 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.69 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.70 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.71 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.72 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.73 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.74 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.75 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.76 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.77 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.78 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.79 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.80 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.81 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.82 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.83 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.84 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.85 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.86 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.87 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.88 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.89 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.90 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.91 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.92 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.93 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.94 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.95 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.96 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.97 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.98 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.99 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.100 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.101 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.102 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.103 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.104 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.105 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.106 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.107 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.108 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.109 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.110 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.111 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.8.4.112 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4