兴全货币市场证券投资基金

【2010】年度报告摘要

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
报告送出日期:二〇一一年三月三十日

§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。

基金的托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月28日复核了本报告中的财务指标、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,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全货币
基金主代码	340005
交易代码	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	341,974,566.51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	徐天舒	张志永
	联系电话	021-58368998	021-62677777
	电子邮箱	xuts@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099,021-38824536	95561
传真		021-58368858	021-62159217

注:本基金管理人于2011年3月9日公告,自2011年3月5日起,原公司督察长杜建新离任,由公司副总经理徐天舒代行督察长职务。

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xyfunds.com.cn
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

§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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	3,753,322.67	8,169,608.46	19,230,946.66
本期利润	3,753,322.67	8,169,608.46	19,230,946.66
本期净值收益率	1.1426%	1.0000%	3.2500%
3.1.2期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末基金资产净值	341,974,566.51	1,385,821,777.40	1,334,606,893.70
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3累计期末指标	2010年末	2009年末	2008年末
累计净值收益率	10.3052%	9.0600%	7.9800%

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

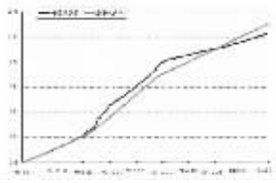
3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3485%	0.0018%	0.4991%	0.0000%	-0.1506%	0.0018%
过去六个月	0.6466%	0.0013%	0.9981%	0.0000%	-0.3515%	0.0013%
过去一年	1.1426%	0.0012%	1.9800%	0.0000%	-0.8374%	0.0012%
过去三年	5.4780%	0.0057%	7.3940%	0.0020%	-1.9160%	0.0037%
自基金成立起至今	10.3052%	0.0062%	11.0211%	0.0019%	-0.7159%	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份额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

兴全货币市场证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年4月27日至2010年12月31日)

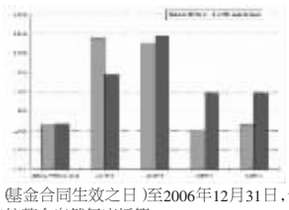


注:1、净值表现所取数据截至到2010年12月31日。

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自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全货币市场证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值收益率图



注:2006年4月27日(基金合同生效之日)至2006年12月31日,合同生效当年净值收益率按实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位: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
2010年	2,991,911.83	744,468.70	16,942.14	3,753,322.67	-
2009年	8,324,858.42	1,157,891.71	-1,313,141.67	8,169,608.46	-
2008年	15,258,814.53	2,849,710.87	1,122,421.26	19,230,946.66	-
合计	26,575,584.78	4,752,071.28	-173,778.27	31,153,877.79	-

§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2010年12月31日,公司旗下管理着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)共9只基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
李友超	基金经理	2007-04-17	-	8年	1965年生,数量经济专业硕士,历任安徽农师院助教、建设银行滁州分行支行行长、建设银行监察室监察员、平安资产管理公司交易员、华富货币市场基金基金经理(2006年6月21日至2007年1月12日)。现任本基金基金经理(2007年4月17日起至今)、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理。

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"按照中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定计算。

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。

4.3.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

目前,本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

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

2010年,全球经济冷暖互现,以美国为代表的全球主要经济体都在低迷中徘徊,为了提振低迷的经济,美国重启量化宽松政策,流动性泛滥带来世界盛宴的同时,也给部分发展中国家带来了输入性通货膨胀的风险。同时以希腊、爱尔兰为首的欧债危机愈演愈烈,欧洲经济局势动荡不安。中国经济保持总体向好,各项经济指标不断回暖,消费、投资、进出口保持较高增速。然而,CPI持续上涨,由年初的1.5%到11月份的5.1%,通胀预期不断增强。2010年人民币升值预期强烈,热钱和贸易顺差不断增加。为了回收过于宽裕的流动性和抑制通货膨胀,人民银行年内六次上调商业银行存款准备金率,加息两次。

2010年全年债券市场先扬后抑,波动比较大。债券市场经历四个波段:第一波,5月份前经济好转、信贷投放受限而通胀水平较低,债券市场出现了牛市情结,上涨幅度可观;第二波,6月底前市场资金开始紧张,货币市场利率上升,债券出现短暂调整;第三波,2010年三季度,市场预期中的严厉调控没有出现,债券市场盘整、小幅上涨,信用债交易较为活跃;第四波段,2010年四季度CPI快速上升,人行三次上调准备金、两次加息,市场资金长时间紧张,回购利率达到8%以上,债券市场遭受重创。

报告期初我们提出重点关注资金利率和央票利率变化,认为货币调控以数量为主,当数量调控紧积到一定程度,资金面可能收紧,资金利率可能上升,同时为了提高一年期以上央票发行量,央票利率也可能多次提高。因此,2010年我们奉行稳健的投资风格,跟随调控节奏控制久期,持有品种集中在流动性较好的品种上,较好地防范了利率和流动性风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为1.1426%,同期业绩比较基准收益率为1.9800%。

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2011年,外部环境困扰仍在,欧债危机没有完全消去,中东动荡又起,但值得欣慰的是美国经济好转明显,地缘政治的动荡不会扭转世界经济的复苏,中国外贸形势可能不会太差。国内粗放式的经济增长方式将在2011年开始转变,"十二五"规划明确提出转变经济增长方式,2011年是"十二五"规划开局之年,也将是转变的元年,改变需要时间,因此,控通胀、调结构将成为2011年经济工作主旋律。

2011年调控将占主导地位,政策将在控通胀、调结构与保经济增长之间不断摇摆,调控时紧时松。如果调控得当,通胀受控经济活力依旧;调控不够,通胀将起;调控过头,经济受损。我们判断政策取向将是维持、延长本轮经济周期,政策摇摆和迟疑很可能推迟调控和减缓调控效果,一、三季度有可能是调控重要时间段。

鉴于以上认识,我们预计2011年债券市场可能受政策左右,随着调控严厉、放松、再调控,债券市场可能出现波浪式行情,行情大小看市场资金状况和时间延续长短,市场预期的下半年债券牛市有可能不会出现。

货币基金主要投资短期品种,与短期利率变化关系密切,因此2011年重点关注货币政策动向,资产配置调整速度需要更快、更精准。

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。

本基金未签订任何与估值相关的定价服务。

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8,169,608.46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

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(2011)审字第60467611_B03号
备注	投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:			
银行存款		106,771,804.40	851,579,744.45
结算备付金		136,363.64	142,857.14
存出保证金		-	-
交易性金融资产		79,859,652.12	280,761,543.11
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		79,859,652.12	280,761,543.11
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		148,000,552.00	235,200,792.80
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,098,584.17	6,646,570.62
应收股利		-	-
应收申购款		5,680,808.82	12,295,625.84
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		342,547,765.15	1,386,627,133.96
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2010年12月31日**	**上年度末 2009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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,201.19	128,762.10
应付托管费		21,879.14	39,018.83
应付销售服务费		142,382.69	318,033.90
应付交易费用		5,016.80	4,765.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		277,218.82	260,276.68
递延所得税负债		-	-
其他负债		54,500.00	54,500.00
负债合计		573,198.64	805,356.56
所有者权益:			
实收基金		341,974,566.51	1,385,821,777.40
未分配利润		-	-
所有者权益合计		341,974,566.51	1,385,821,777.40
负债和所有者权益总计		342,547,765.15	1,386,627,133.96

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额341,974,566.51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:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		6,321,662.88	13,568,245.06
1.利息收入		6,395,147.27	12,473,177.59
其中:存款利息收入		1,533,272.79	4,094,922.68
债券利息收入		4,255,453.34	7,653,286.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		606,421.14	724,968.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-73,484.39	1,095,067.47
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-73,484.39	1,095,067.47
资产支持证券投资收益		-	-
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		2,568,340.21	5,398,636.60
1.管理人报酬		1,151,358.90	2,522,608.47
2.托管费		348,896.65	764,426.80
3.销售服务费		872,241.68	1,911,067.09
4.交易费用		-	-
5.利息支出		39,820.76	40,849.49
其中:卖出回购金融资产支出		39,820.76	40,849.49
6.其他费用		156,022.22	159,684.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3,753,322.67	8,169,608.46
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		3,753,322.67	8,169,608.46

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:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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)	1,385,821,777.40	-	1,385,821,777.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,753,322.67	3,753,322.67
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)	-1,043,847,210.89	-	-1,043,847,210.89
其中:1.基金申购款	2,976,033,717.56	-	2,976,033,717.56
2.基金赎回款	-4,019,880,928.45	-	-4,019,880,928.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-3,753,322.67	-3,753,322.67
五、期末所有者权益(基金净值)	341,974,566.51	-	341,974,566.51
项目	**上年度可比期间 2009年1月1日至2009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)	1,334,606,893.70	-	1,334,606,893.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,169,608.46	8,169,608.46
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)	51,214,883.70	-	51,214,883.70
其中:1.基金申购款	4,157,647,526.23	-	4,157,647,526.23
2.基金赎回款	-4,106,432,642.53	-	-4,106,432,642.53
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)	-	-8,169,608.46	-8,169,608.46
五、期末所有者权益(基金净值)	1,385,821,777.40	-	1,385,821,777.40

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:兰荣,主管会计工作负责人:杨东,会计机构负责人:詹鸿飞

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(原名"兴业基金管理有限公司")作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2006年4月27日正式生效,首次设立募集规模为1,729,582,293.12份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。兴业货币市场证券投资基金于2011年1月1日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2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行<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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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。

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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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

本基金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。

7.4.5税项

1.营业税、企业所得税

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

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

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入,由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.6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	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	基金托管人、基金代销机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司	基金管理人的股东

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。

7.4.7本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1通过关联方交易单元进行的交易

本基金2010年度及2009年度除债券回购交易外,未通过关联方交易单元进行其他交易。

7.4.7.1.1债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	365,000,000.00	100.00%	914,000,000.00	100.00%

7.4.7.2关联方报酬

7.4.7.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,151,358.90	2,522,608.47
其中:支付销售机构的客户维护费	97,874.96	349,171.01

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:

H=E×0.33%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.7.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	348,896.65	764,426.80

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:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金财产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.7.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010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	580,787.20
兴业证券	24,941.18
兴业银行	118,690.11
合计	724,418.49
获得销售服务费的各关联方名称	**上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	876,770.66
兴业证券	348,264.51
兴业银行	224,106.86
合计	1,449,142.03

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:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各代销机构。

7.4.7.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金2010年度及2009年度均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.7.4各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人2010年度及2009年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.7.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于2010年年末及2009年年末均未投资本基金。

7.4.7.5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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	6,771,804.40	630,923.59	851,579,744.45	4,021,607.14

7.4.7.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2010年度及2009年度均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.8利润分配情况

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
2,991,911.83	744,468.70	16,942.14	3,753,322.67	-

7.4.9期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

7.4.9.2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。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场正回购抵押债券。

7.4.9.3.2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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	79,859,652.12	23.31
	其中:债券	79,859,652.12	23.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	148,000,552.00	43.21
	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	106,908,168.04	31.21
4	其他各项资产	7,779,392.99	2.27
	合计	342,547,765.15	100.00

8.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		0.64
	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	-	-
	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。

8.3债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.4基金投资组合平均剩余期限

8.4.1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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	146
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

8.4.2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	58.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	16.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	14.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	8.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	97.89	-

8.5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	79,859,652.12	23.35
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	79,859,652.12	23.35
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	0801029	08央行票据29	500,000