

兴全货币市场证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关法规和基金合同关于估值的约定,对基金投资资产进行估值。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、估值方法确立后,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操作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(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,并按月结转给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32,018,108.147元,符合本基金基金合同的相关规定。

§ 6 托管人报告

6.1 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”)(以下简称“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。

6.2 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,对基金管理人和本基金的证券投资行为、基金资产净值的计算、基金费用和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。

6.3 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:2014年6月30日

| 资产 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|------------|-----|-------------------|---------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 535,097,029.93 | 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 | | 500,328,546.05 | 539,649,459.78 |
| 其中:股票投资 | | — | — |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | 500,328,546.05 | 539,649,459.78 |
| 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 | | — | 568,300,133.50 |
| 应收清算款 | | — | — |
| 应收利息 | | 12,614,736.34 | 12,603,738.77 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 26,544,287.91 | 3,510,110.09 |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | | — | — |
| 资产总计 | | 1,074,584,600.23 | 2,176,624,135.68 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | — | — |
| 交易性金融负债 | | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | — | — |
| 应付清算款 | | — | — |
| 应付债券 | | 94,959,562.52 | 394,300,000.00 |
| 应付赎回款 | | 972,688.70 | 128,470.23 |
| 应付管理人报酬 | | 333,302.85 | 362,942.12 |
| 应付托管费 | | 101,028.13 | 109,982.47 |
| 应付销售服务费 | | 252,570.35 | 274,956.16 |
| 应付交易费用 | | 16,547.41 | 22,241.81 |
| 应交税费 | | — | — |
| 应付利息 | | 87,721.73 | — |
| 应付股利 | | 1,923,088.80 | 3,225,362.20 |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | | 72,586.80 | 139,614.02 |
| 负债合计 | | 98,719,157.29 | 398,563,560.01 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 975,865,442.94 | 1,778,060,566.67 |
| 未分配利润 | | — | — |
| 所有者权益合计 | | 975,865,442.94 | 1,778,060,566.67 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,074,584,600.23 | 2,176,624,135.68 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额975,865,442.94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:2014年1月1日至2014年6月30日

| 资产 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 30,038,186.29 | 18,367,844.95 |
| 1.利息收入 | | 34,866,450.11 | 16,019,224.14 |
| 其中:存款利息收入 | | 25,422,222.09 | 9,622,590.21 |
| 债券利息收入 | | 8,307,362.64 | 4,677,545.83 |
| 资产支持证券利息收入 | | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,136,865.38 | 2,518,088.10 |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2.投资收益(损失以“-”号填列) | | 3,171,736.18 | 1,549,620.81 |
| 其中:股票投资收益 | | — | — |
| 基金投资收益 | | — | — |
| 债券投资收益 | | 3,171,736.18 | 1,549,620.81 |
| 资产支持证券投资收益 | | — | — |
| 贵金属投资收益 | | — | — |
| 衍生工具投资收益 | | — | — |
| 股利收益 | | — | — |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | 6,020,078.15 | 3,471,408.59 |
| 4.其他收入(损失以“-”号填列) | | — | — |
| 减:二、费用 | | 6,020,078.15 | 3,471,408.59 |
| 1.管理人报酬 | | 2,422,292.97 | 1,540,925.39 |
| 2.托管费 | | 734,028.15 | 466,947.11 |
| 3.销售服务费 | | 1,835,070.47 | 1,167,367.76 |
| 4.交易费用 | | — | — |
| 5.利息支出 | | 32,591,261.26 | 193,208.05 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 925,361.26 | 193,208.05 |
| 6.其他费用 | | 103,325.30 | 102,960.28 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 32,018,108.14 | 14,896,436.36 |
| 减:所得税费用 | | — | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 32,018,108.14 | 14,896,436.36 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额975,865,442.94份。

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:2014年1月1日至2014年6月30日

| 资产 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 一、收入 | | 30,038,186.29 | 18,367,844.95 |
| 1.利息收入 | | 34,866,450.11 | 16,019,224.14 |
| 其中:存款利息收入 | | 25,422,222.09 | 9,622,590.21 |
| 债券利息收入 | | 8,307,362.64 | 4,677,545.83 |
| 资产支持证券利息收入 | | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,136,865.38 | 2,518,088.10 |
| 其他利息收入 | | — | — |
| 2.投资收益(损失以“-”号填列) | | 3,171,736.18 | 1,549,620.81 |
| 其中:股票投资收益 | | — | — |
| 基金投资收益 | | — | — |
| 债券投资收益 | | 3,171,736.18 | 1,549,620.81 |
| 资产支持证券投资收益 | | — | — |
| 贵金属投资收益 | | — | — |
| 衍生工具投资收益 | | — | — |
| 股利收益 | | — | — |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | | 6,020,078.15 | 3,471,408.59 |
| 4.其他收入(损失以“-”号填列) | | — | — |
| 减:二、费用 | | 6,020,078.15 | 3,471,408.59 |
| 1.管理人报酬 | | 2,422,292.97 | 1,540,925.39 |
| 2.托管费 | | 734,028.15 | 466,947.11 |
| 3.销售服务费 | | 1,835,070.47 | 1,167,367.76 |
| 4.交易费用 | | — | — |
| 5.利息支出 | | 32,591,261.26 | 193,208.05 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 925,361.26 | 193,208.05 |
| 6.其他费用 | | 103,325.30 | 102,960.28 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 32,018,108.14 | 14,896,436.36 |
| 减:所得税费用 | | — | — |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 32,018,108.14 | 14,896,436.36 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额975,865,442.94份。

6.4 基金管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴全全球基金管理有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)是经证监基金字[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61%,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“兴全全球人寿基金管理有限公司”,公司注册资本由9800万元变更为1.2亿元人民币。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“兴全全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴全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1.5亿元人民币,其中两股东出资比例不变。

截止2014年6月30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(LOP)、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、兴全睿利混合型证券投资基金、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(LOP)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOP)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全成长投资股票型证券投资基金(LOP)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOP)、兴全添利宝货币市场基金。

4.2 基金业绩(或基金净值小组)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 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---|-------------------------|------|--------|---|
| 杨云 | 固定收益部总监、本基金、兴全货币市场证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金、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、兴全睿利混合型证券投资基金、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(LOP)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOP)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全成长投资股票型证券投资基金(LOP)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOP)、兴全添利宝货币市场基金 | 2014年6月10日 | - | 12年 | 1974年生,理学硕士,历任中国银河证券研究所金融工程组、策略研究组研究员,兴全可转债混合型证券投资基金的基金经理,兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监。 |
| 张娜 | 2012年6月29日 | 2014年6月10日 | - | - | - |

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.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守了《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,基金投资组合管理符合有关法律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,确保投资者的合法权益。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

2014年上半年流动性环境较去年明显宽松,M1、M2等货币供应指标均有所回升;上半年新增社会融资1.05万亿,比去年同期多4000亿左右,新增贷款比去年同期高13%,自1月份央行提出地方、金融机构开展常备借贷便利(SLF)、推行利率走廊机制以来,刺激政策逐渐加码,4月份央行进一步下调央行和金融机构准备金率,5月再贷款,6月再次定向下调准备金率,127万亿推出对商业银行的资产配置影响等多项措施刺激,配合经济基本面低于预期的不景气,债券市场出现了一波牛市行情。10年期国债收益率下行约50BP,1年期国债收益率下行近84BP,国债收益率下行幅度更大,1年期高达120BP;信用债方面,短端相对于长端、高评级相对于低评级、短融资相对于企业债来说,下行幅度更大。本报告期内,配置上以评级相对较高的高信用资质和不同期限的银行存单为主,考虑到货币市场流动性要求及应对半年末及IPO等不确定因素带来的冲击,总体策略侧重维持较短的配置久期并伺机捕捉半年末收益上行出现的机会。

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2.2498%,同期业绩比较基准收益率1.3835%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年债市将承受更多基本面的压力,在全年经济增速低5%的基调下,短期经济企稳,资金面受新股发行及季节性影响或比二季度收紧的可能性不大;加之利率继续供给出现高峰,不排除债市在三季度出现震荡。债市经历上半年由资金面推动的交易型牛市,市场杠杆已处于不低水平,机构进一步加仓力度减弱,叠加市场频繁曝出违约风险,可能导致信用利差上升和信用调整,下半年债市的行情情绪或由乐观转为谨慎。下半年本基金在策略上,积极调整并优化资产结构,降低流动性风险的同时,兼顾收益。在客户结构调整过程中,逐步加大现券配置力度,适当拉长组合久期。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本管理人按照最新的估值准则、证监会相关法规和基金合同关于估值的约定,对基金投资资产进行估值。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、估值方法确立后,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操作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(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,并按月结转给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32,018,108.147元,符合本基金基金合同的相关规定。

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:2014年6月30日

| 资产 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|-----|----------------------------|---------------------------------|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 535,097,029.93 | 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 | | 500,328,546.05 | 539,649,459.78 |
| 其中:股票投资 | | — | — |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | 500,328,546.05 | 539,649,459.78 |
| 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 | | — | 568,300,133.50 |
| 应收清算款 | | — | — |
| 应收利息 | | 12,614,736.34 | 12,603,738.77 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 26,544,287.91 | 3,510,110.09 |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | | — | — |
| 资产总计 | | 1,074,584,600.23 | 2,176,624,135.68 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | — | — |
| 交易性金融负债 | | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | — | — |
| 应付清算款 | | — | — |
| 应付债券 | | 94,959,562.52 | 394,300,000.00 |
| 应付赎回款 | | 972,688.70 | 128,470.23 |
| 应付管理人报酬 | | 333,302.85 | 362,942.12 |
| 应付托管费 | | 101,028.13 | 109,982.47 |
| 应付销售服务费 | | 252,570.35 | 274,956.16 |
| 应付交易费用 | | 16,547.41 | 22,241.81 |
| 应交税费 | | — | — |
| 应付利息 | | 87,721.73 | — |
| 应付股利 | | 1,923,088.80 | 3,225,362.20 |
| 递延所得税负债 | | — | — |
| 其他负债 | | 72,586.80 | 139,614.02 |
| 负债合计 | | 98,719,157.29 | 398,563,560.01 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 975,865,442.94 | 1,778,060,566.67 |
| 未分配利润 | | — | — |
| 所有者权益合计 | | 975,865,442.94 | 1,778,060,566.67 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,074,584,600.23 | 2,176,624,135.68 |

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额975,865,442.94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:2014年1月1日至2014年6月30日

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 兰荣 | 杨东 | 詹腾飞 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

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注册及兴全货币市场证券投资基金基金合同、基金托管协议和基金招募说明书核准》的2006年4月1日生效,首次设立募集规模为1,729,582,282.1份,本基金为开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司,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