

## 兴业货币市场证券投资基金

[2014] 第四季度报告

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2015年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员不存在虚假记载、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责任。

基金托管人和基金管理人保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金托管人和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未来表现。投资人投资于基金，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。

本基金报告为财务资料未经审计。

本报吿期自2014年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称：兴业货币A

基金代码：000721

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年8月6日

报告期末基金份额总额：1,479,498,684.41份

投资目标：本基金的投资目标是在保持较低风险的前提下，通过主动大类管理，力争获得超越基准收益的绝对回报。

投资策略：本基金在充分考虑预期收益率、利差定价分析及定价方法，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得当期收益。

业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为：7天通知存款利率(税后)

风险收益特征：本基金的货币市场基金，属于投资于货币市场基金的低风险品种，其预期收益低于同期限的货币市场基金，但不能保证本金安全。

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称：兴业货币A

基金代码：000721

报告期末下属分级基金的份额总额：1,479,498,684.41份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)

营业收入A

兴业货币A

1. 本期已实现收益 12,532,854.84元 62,646,937.37

2.本期利润 12,532,854.84元 62,646,937.37

3.加权平均基金份额本期利润 1,474,498,684.41元 9,334,964,972.73

注：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=本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业货币A

报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)

阶段 净值收益率① (%) 业绩比较基准收益率② (%) 标准差③ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 1.0568% 0.0014% 0.3403% 0.0000% 0.7165% 0.0014%

3.2.1 本期报告期基金净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业货币A

报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)

阶段 净值收益率① (%) 业绩比较基准收益率② (%) 标准差③ (%) ①-③ (%) ②-④ (%)

过去三个月 1.1179% 0.0014% 0.3403% 0.0000% 0.7776% 0.0014%

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

兴业货币A

报告期(2014年10月1日 - 2014年12月31日)

注：本基金于2014年8月6日成立，截至报告期末本基金成立满一年。根据《兴业货币市场证券投资基金基金合同》规定，基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

3.3 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 截至报告期末任职时间

朱文輝 本基金的基金经理 2014年8月6日 - 13 13

说明：中国籍，硕士学历，具有证券投资基金管理经验，先后任职于平安资产管理有限公司、中银基金管理有限公司，公司客户服务部基金经理，2013年1月加入本公司，现任基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本报告期内，本基金经理严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚信原则，勤勉尽责的原则管理并运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 公平交易制度的执行情况

4.5 公平交易制度的执行情况

4.6 公平交易制度的执行情况

4.7 公平交易制度的执行情况

4.8 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收利息 56,187,494.44

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 待摊费用 -

7 其他 -

8 合计 1,479,498,684.41

5.6 报告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

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊卖成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 140412 14国开12 2,500,000 250,598,972.85 2.32

2 04146108 14福能能源 CP002 1,500,000 149,857,063.15 1.39

3 01142907 14招行SCP007 1,500,000 149,406,559.24 1.38

4 04145052 14中行CP002 1,300,000 130,250,796.17 1.20

5 01437007 14广发银行 SCP002 1,200,000 120,310,107.84 1.11

6 04146052 14农行1200 CP001 1,000,000 99,955,191.64 0.92

7 041320 14农行20 900,000 90,100,765.13 0.83

8 120129 12浦发19 900,000 89,884,008.84 0.83

9 04145105 14八达岭CP004 700,000 70,146,504.85 0.65

10 04146204 14光大银行 CP003 600,000 60,002,236.44 0.56

5.6.1 报告期内定存“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(2014年10月1日 - 2014年12月31日) 的2.02%(-0.5%)之间的次数 -

报告期(2014年12月31日) 的最高偏离 0.0933%

报告期(2014年12月31日) 的最低偏离 -0.0767%

报告期(2014年12月31日) 的偏离标准差 0.0493%

注：1.本基金于2014年8月6日成立，截至报告期末本基金成立满一年。根据《兴业货币市场证券投资基金基金合同》规定，基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

2.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

3.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

4.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

5.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

6.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

7.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

8.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

9.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

10.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

11.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

12.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

13.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

14.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

15.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

16.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

17.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

18.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

19.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

20.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

21.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

22.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

23.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

24.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

25.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

26.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

27.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

28.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

29.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

30.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

31.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

32.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

33.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

34.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

35.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

36.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

37.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

38.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

39.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

40.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

41.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

42.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

43.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

44.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

45.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

46.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

47.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

48.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

49.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

50.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

51.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

52.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

53.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

54.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

55.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的有关规定。

56.本基金的基金合同生效后第一个自然日起，六个月内的基金投资组合比例符合基金合同的