兴全货币市场证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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
送出日期:2015年8月26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2015年8月25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2015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	1,110,381,091.21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
信息披露负责人	姓名	冯晓蓬	张志永
	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(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	18,687,626.23
本期利润	18,687,626.23
本期净值收益率	2.3380%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015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	1,110,381,091.21
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。

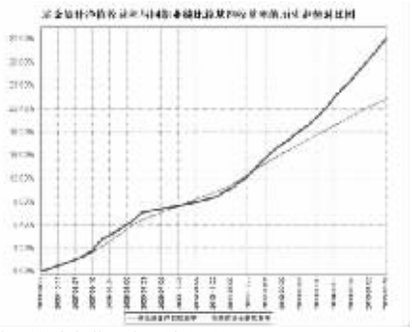
3.2 基金净值表现

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	0.3395%	0.0054%	0.1664%	0.0002%	0.1731%	0.0052%
过去三个月	1.1562%	0.0051%	0.5364%	0.0004%	0.6198%	0.0047%
过去六个月	2.3380%	0.0049%	1.1440%	0.0006%	1.1940%	0.0043%
过去一年	4.8184%	0.0064%	2.5281%	0.0007%	2.2903%	0.0057%
过去三年	13.2209%	0.0049%	8.1315%	0.0006%	5.0894%	0.0043%
自基金合同生效起至今	32.0341%	0.0061%	23.6870%	0.0016%	8.3471%	0.0045%

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



注:1、净值表现所取数据截至到2015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(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”,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1.5亿元人民币,其中两股东出资比例不变。

截止2015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(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)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金。

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		
杨云	总经理助理、固定收益部总监、本基金、兴全可转债混合型证券投资基金和兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2014年6月10日	-	13年	理学硕士,历任申银万国证券研究所金融工程部、策略部研究员;兴全可转债混合型证券投资基金的基金经理助理,兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监。
钟明	本基金、兴全添利宝货币市场基金基金经理	2015年6月30日	-	10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。

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。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、考察是否存在非公平的因素。

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

2015年二季度,收益率曲线整体下行,短端下行显著,长端略有下降,曲线陡峭化。短端下行主要是受益于宽松的货币政策,也受益于实体经济对资金需求疲弱。长端表现则较为纠结,一方面,宏观经济数据持续走弱,通缩压力存在,名义增长率下降到接近2008年的低位,货币政策两度降息两度降准,资金面和基本面都支持长端下降;但另一方面,市场担心稳增长政策带来经济企稳预期加强,也担忧地方债置换的持续性大量供给。因而长端几经波动,略有下降。收益率曲线的陡峭化为套息策略创造了良好的回报。

基金精选了安全边际充分的信用债,采用套息策略进行运作,同时也获得了收益率曲线下移的收益。

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2.3380%,同期业绩比较基准收益率1.1440%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期而言,我国宏观经济增速长期放缓趋势较为确定,经济转型压力仍大。名义增长率放缓将为长端收益率下行创造良好基础。制约长端收益率下行的因素大部分正在减弱。首先,新股IPO暂停、再融资放缓以及两融、配资等高收益优先级产品将减少,有利于债券市场性价比优势显出;第二,地方债已经发行9000亿发行,第二批1万亿额度已批复,其对债券市场的心理影响和挤出影响边际减弱。此外,三季度作为传统淡季,经济弱势运行态势仍将持续,货币政策在股票市场泡沫挤破后顾虑将减少,有进一步宽松的可能。所以,我们相对看好固定收益类市场的后续机会, 不过也将重点关注经济企稳预期形成对债市的可能的负面影响。

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。

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?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

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。

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:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		474,601,203.42	500,252,419.94
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		416,352,151.64	270,817,513.42
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		416,352,151.64	270,817,513.42
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		182,111,033.17	30,000,245.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		13,812,438.86	9,168,419.27
应收股利		-	-
应收申购款		40,708,226.95	33,114,119.17
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,127,585,054.04	843,352,716.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		10,779,874.61	121,999,417.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,786,654.46	2,309,699.71
应付管理人报酬		266,119.75	170,103.39
应付托管费		80,642.34	51,546.51
应付销售服务费		201,605.89	128,866.23
应付交易费用		31,358.65	24,834.07
应交税费		-	-
应付利息		521.15	20,557.33
应付利润		1,973,574.36	1,569,929.47
递延所得税负债		-	-
其他负债		83,611.62	65,433.61
负债合计		17,203,962.83	126,340,387.32
所有者权益:			
实收基金		1,110,381,091.21	717,012,329.48
未分配利润		-	-
所有者权益合计		1,110,381,091.21	717,012,329.48
负债和所有者权益总计		1,127,585,054.04	843,352,716.80

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额1,110,381,091.21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: 2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		22,712,293.21	38,038,186.29
1.利息收入		20,045,634.10	34,866,450.11
其中:存款利息收入		12,395,951.24	25,422,222.09
债券利息收入		6,389,210.12	8,307,362.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,260,472.74	1,136,865.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		2,666,659.11	3,171,736.18
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,666,659.11	3,171,736.18
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		4,024,666.98	6,020,078.15
1. 管理人报酬		1,330,733.42	2,422,292.97
2. 托管费		403,252.55	734,028.15
3. 销售服务费		1,008,131.43	1,835,070.47
4. 交易费用		30.00	-
5. 利息支出		1,175,111.12	925,361.26
其中:卖出回购金融资产支出		1,175,111.12	925,361.26
6. 其他费用		107,408.46	103,325.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		18,687,626.23	32,018,108.14
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		18,687,626.23	32,018,108.14

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	1,778,060,566.67	-	1,778,060,566.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	32,018,108.14	32,018,108.14
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)	-802,195,123.73	-	-802,195,123.73
其中:1.基金申购款	4,511,555,087.60	-	4,511,555,087.60
2.基金赎回款	-5,313,750,211.33	-	-5,313,750,211.33
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)	-	-32,018,108.14	-32,018,108.14
五、期末所有者权益(基金净值)	975,865,442.94	-	975,865,442.94

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:

_____兰荣_____ _____杨东_____ ____詹鸿飞____

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。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。

6.4.2 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,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2015年6月30日的财务状况以及2015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不一致。详见6.4.5。

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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的要求, 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定:自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	-	-	480,000,000.00	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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,330,733.42	2,422,292.97
其中:支付销售机构的客户维护费	287,961.73	107,529.47

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	403,252.55	734,028.15

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 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
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	1,520,842.32
兴业证券	43,295.03
兴业银行	72,802.57
合计	1,636,939.92

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
期初持有的基金份额	226,139.52	50,097,419.20
期间申购/买入总份额	1,340,063.98	367,574,765.31
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	402,500,000.00
期末持有的基金份额	1,566,203.50	15,172,184.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1411%	1.5547%

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 2015年6月30日		上年度末 2014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	1,116,653.39	0.0101%	112,258.15	0.0200%

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	4,601,203.42	176,416.57	5,097,029.93	3,147,718.60

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(2015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

本基金本期末未持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股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2015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10,779,874.61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
140443	14农发43	2015年7月1日	100.08	110,000	11,008,800.00
合计				110,000	11,008,800.00

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	416,352,151.64	36.92
	其中:债券	416,352,151.64	36.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	182,111,033.17	16.15
	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	474,601,203.42	42.09
4	其他各项资产	54,520,665.81	4.84
5	合计	1,127,585,054.04	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	8.66	
	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	10,779,874.61	0.97
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2015年3月3日	20.51	赎回波动超标	2015-03-04
2	2015年3月10日	32.43	巨额赎回	2015-03-11
3	2015年6月17日	21.24	巨额赎回	2015-06-18

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????????	128
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	172
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	104

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过180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	33.03	0.97
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	5.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	15.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	35.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		96.65	0.97

7.4 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	55,076,836.96	4.96
	其中:政策性金融债	55,076,836.96	4.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	341,183,475.92	30.73
6	中期票据	20,091,838.76	1.81
7	其他	-	-
8	合计	416,352,151.64	37.50
9	剩余存续期超过397天的