

# 兴业货币市场证券投资基金

## 2010 年第 2 季度报告

2010 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇一〇年七月十九日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。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 2010 年 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	兴业货币
基金代码	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
报告期末基金份额总额	344,234,688.08份
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。
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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010 年 4 月 1 日-2010 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	939,114.41
2.本期利润	939,114.41
3.期末基金资产净值	344,234,688.08

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，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

#### 3.2 基金净值表现

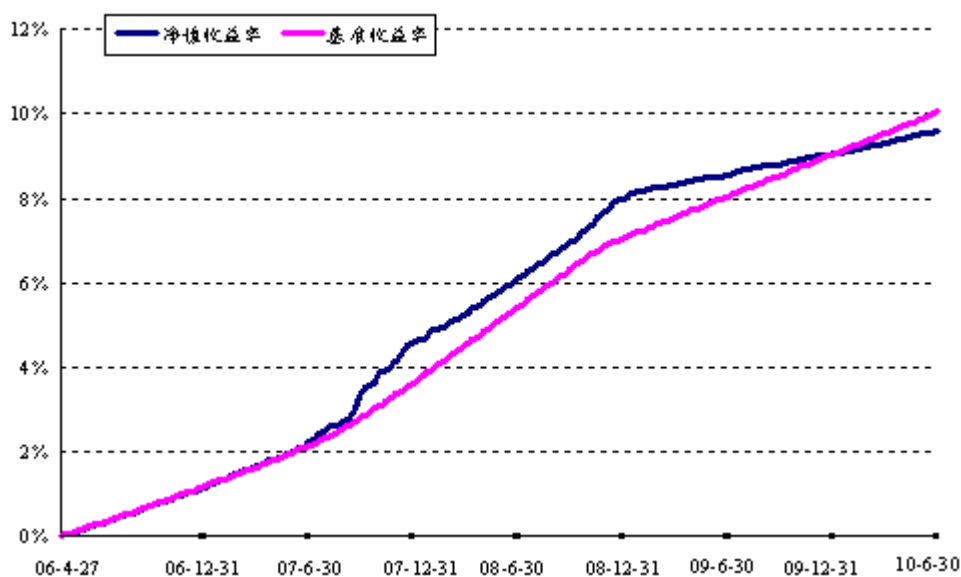
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	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	0.2573%	0.0003%	0.4936%	0.0000%	-0.2363%	0.0003%

注：本基金收益分配按月结转份额。

##### 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的历史走势对比图  
(2006 年 4 月 27 日至 2010 年 6 月 30 日)



注：1、净值表现所取数据截至到 2010 年 6 月 30 日。

2、按照《兴业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 经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李友超	本基金基金 经理、 兴业磐稳 增利债券 型证券投 资基金基 金经理	2007-4-17	-	7 年	1965 年生，理学 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。

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合规守信情况的说明**

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、《兴业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 公平交易专项说明**

##### **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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

报告期内，货币政策延续了上季度调控势头，CPI 和 PPI 创出年内新高，但央行没有加息，继续坚持回收流动性，终于在季末流动性出现了急剧变化，商业银行为了完成存贷比指标大力吸收存款，在行业内资金非常紧张情况下，存款搬

家进一步加剧了资金紧张程度，融资利率快速飙升，央行连续几周向市场投放资金，债券市场深受其害，调整明显，特别是 1 年以下品种收益率快速攀升。与此同时，国内经济开始有偏热转向偏冷，外围经济不振和国内经济调控叠加迅速使经济开始冷却，在消费增长短期内难有大幅增长、投资增速下降、出口受欧美经济不佳拖累背景下，经济快速下滑的预期由弱转强，股票市场因此表现不佳。本基金采取积极防守的短久期组合策略，调整了组合结构，调高活期存款和协议存款比例，提高基金组合流动性，顺利抵御住本次短期利率大幅度波动的冲击。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本季度累计净值收益率为 0.2573%，同期业绩比较基准收益率为 0.4936%。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	229,605,771.76	66.58
	其中：债券	229,605,771.76	66.58
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	109,102,734.50	31.64
4	其他各项资产	6,165,262.07	1.79
5	合计	344,873,768.33	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.40	
	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	-	-
------------	---	---

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 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	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

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。

#### 5.3.2 报告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	17.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	57.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.81	-
4	90 天(含)—180 天	14.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	98.39	-

### 5.4 报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	159,482,456.06	46.33



3	金融债券	70,123,315.70	20.37
	其中：政策性金融债	50,123,831.02	14.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	229,605,771.76	66.70
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	19,999,484.68	5.81

### 5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产净值的 比例(%)
1	0901040	09 央行票据 40	800,000	79,760,034.63	23.17
2	050413	05 农发 13	500,000	50,123,831.02	14.56
3	0901046	09 央行票据 46	500,000	49,804,674.43	14.47
4	0901038	09 央行票据 38	300,000	29,917,747.00	8.69
5	050503	05 工行 03	200,000	19,999,484.68	5.81

### 5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 % (含)-0.5 % 间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.0659%
报告期内偏离度的最低值	-0.0811%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0499%

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.8 投资组合报告附注

#### 5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照实际利率每日计提应收利息，2007 年 7 月 1 日前按直线法，2007 年 7 月 1 日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20% 的情况。

5.8.3 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调



查。

#### 5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,193,869.49
4	应收申购款	4,971,392.58
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,165,262.07

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	347,869,129.51
报告期期间基金总申购份额	767,877,824.61
报告期期间基金总赎回份额	771,512,266.04
报告期期末基金份额总额	344,234,688.08

## §7 备查文件目录

### 7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准兴业货币市场证券投资基金设立的文件
- 2、《兴业货币市场证券投资基金基金合同》
- 3、《兴业货币市场证券投资基金托管协议》
- 4、《兴业货币市场证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

### 7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所

### 7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

兴业全球基金管理有限公司

二〇一〇年七月十九日