

兴全添利宝货币市场基金

2016 年半年度报告

2016 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

送出日期：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10

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	10
§5 托管人报告.....	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	32
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	32
7.6 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	33
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	34
7.9 投资组合报告附注.....	34
§8 基金份额持有人信息.....	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	35
§9 开放式基金份额变动.....	35
§10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	37
10.9 其他重大事件.....	37
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	38
§12 备查文件目录.....	39
12.1 备查文件目录.....	39
12.2 存放地点.....	39
12.3 查阅方式.....	39

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全添利宝货币市场基金
基金简称	兴全添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	000575
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	2014 年 2 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	69,033,166,677.48 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	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	根据宏观形势、利率走势等因素,确定各个阶段的投资组合平均久期、剩余期限等指标,并在这些指标要求的基础上构建投资组合;进行主动投资,有效提高资产组合收益。本基金综合运用类属配置、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。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金

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	冯晓莲	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
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址）
邮政编码	200122	200041
法定代表人	庄园芳	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业全球基金管理有限公司	上海市浦东新区张杨路 500 号时代广场 19-20 楼

§ 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	1,083,257,638.28
本期利润	1,067,642,638.28
本期净值收益率	1.4893%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末基金资产净值	69,033,166,677.48
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
累计净值收益率	10.1681%

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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

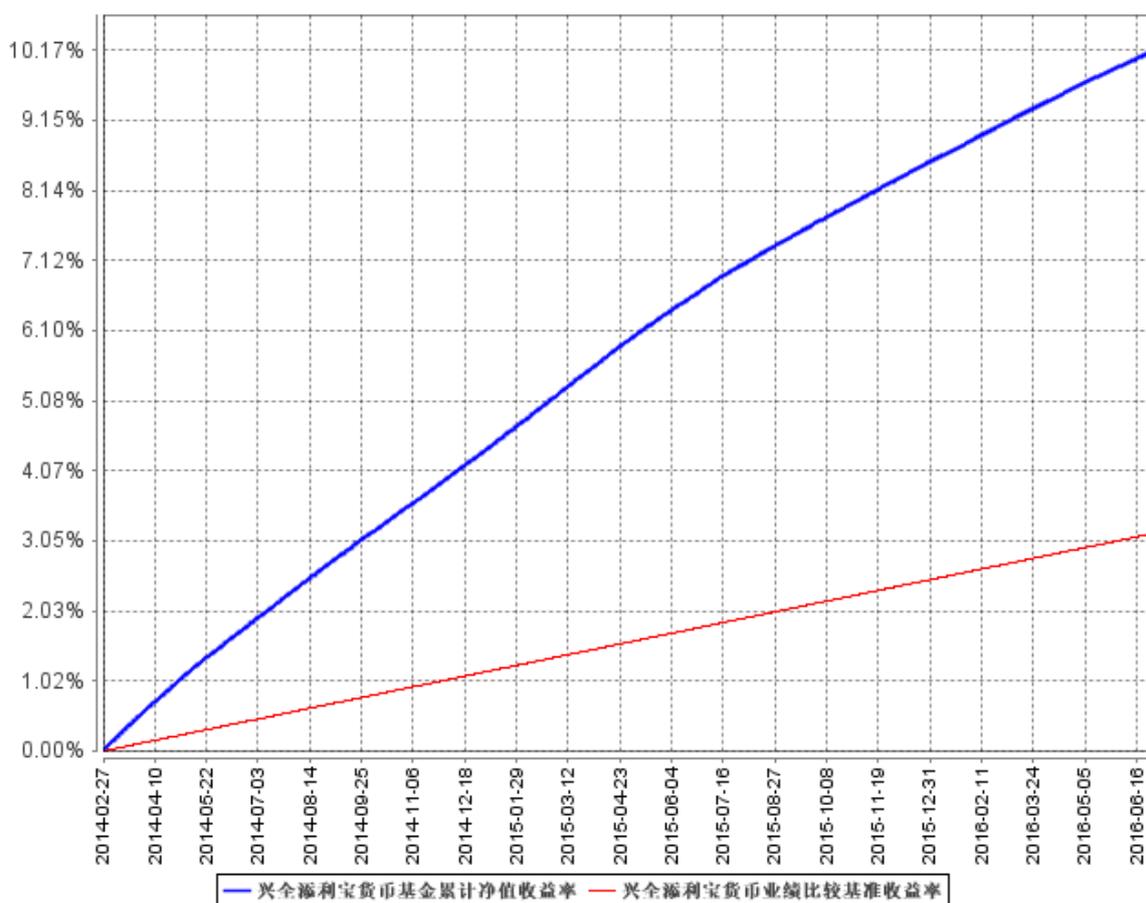
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.2299%	0.0014%	0.1110%	0.0000%	0.1189%	0.0014%
过去三个月	0.7113%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.3747%	0.0012%
过去六个月	1.4893%	0.0012%	0.6732%	0.0000%	0.8161%	0.0012%
过去一年	3.2352%	0.0015%	1.3537%	0.0000%	1.8815%	0.0015%
自基金合同生效起至今	10.1681%	0.0029%	3.1623%	0.0000%	7.0058%	0.0029%

注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后），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

兴全添利宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2014 年 2 月 27 日至

2014 年 5 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。

3.3 其他指标

无。

§ 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是经中国证监会（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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十七只基金，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、兴全社会责任混合型证券投资基金、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、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

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		
钟明	固定收益部 总监助理兼	2015 年 6 月 30 日	-	11 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

	本基金、兴全货币市场基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理				员、基金经理助理。
翟秀华	本基金基金经理	2016 年 3 月 17 日	-	6 年	医学硕士，历任毕马威华振会计师事务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴业全球基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。

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、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》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

回顾上半年，随着全球经济增速进一步放缓，除美国外，主要发达经济体继续实施宽松的货币政策，越来越多的国家步入负利率时代，这对实体经济和金融市场格局的影响将是深刻的。国内方面，全球经济增速放缓使得贸易摩擦加剧，我国的进出口总额占全球贸易份额已然处于高位，继续上升的空间被挤压；消费继续平稳增长；投资则呈现冷暖分化，一方面地产和基建投资较好，另一方面民间投资增速持续大幅下滑。随着宏观调控政策着力点从保增长转向调结构，央行货币政策也从适度宽松转向灵活适度，上半年降准 0.5 个百分点，略低于年初市场预期。但是随着货币工具多样化的发展，央行通过 MLF、公开市场投放的流动性仍然十分充足，银行间资金利率呈现低位企稳，R007 在 2.3-2.5% 之间波动。债券市场方面，随着一季度违约事件集中爆发，且违约级别和规模均为前所未有的，对债券市场形成了一波明显的冲击，收益率曲线出现明显上行，但是随着经济下行压力加大和配置需求旺盛，债券市场重新回归下行通道。在经济内生动力不足、企业部门去杠杆的双重影响下，货币政策继续保持适度宽松态势，大多数时间内，金融体系内流动性充裕。本着对货币政策保持适度宽松的判断和思路，我们采取了稳健的投资策略，基金规模保持基本稳定，适时调整大类资产的配置比例，实现了远超基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率 1.4893%，同期业绩比较基准收益率 0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国际经济环境看，全球经济复苏不及预期，分化和震荡仍将持续，去全球化和贸易保护主义抬头，地缘政治问题频现。英国脱欧的影响还将持续，美联储后续货币政策的节奏、力度等仍有较大不确定性，部分经济体出台的负利率等非常规货币政策，这些政策的溢出效应将对全球金融市场以及宏观政策等产生影响，金融市场不确定性有所加大。从国内经济运行看，结构性矛盾仍然突出，经济对房地产和基建投资的依赖较大，消费平稳增长，民间投资增速及其占比继续下降，经济内生增长动力仍待增强，经济转型任务依然艰巨，从而对国内债券市场形成较强的支撑。随着货币政策对经济拉动的边际效应减弱和人民币贬值预期重启，央行进一步放松的意愿大幅减弱，预计短端利率进一步下降的空间有限。不过实体投资需求不足导致大量流动性淤积在金融市场中，使得金融资产价格轮番上涨，债市也将继续充分受益与此，保持牛市格局。国内日益加强的金融监管将持续对金融市场产生影响，目前来看，监管的加强对债市有利因素较多。展望未来，

投资需求不足、地方债置换后的金融市场配置压力仍将存在，预计平坦收益率曲线窄幅震荡态势仍将持续一段时间。

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》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》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，并按日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 1,067,642,638.28 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

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合规守信、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：兴全添利宝货币市场基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	41,320,043,966.79	35,058,445,196.03
结算备付金		141,121.92	17,588,095.24
存出保证金		1,884.26	-
交易性金融资产	6.4.7.2	25,814,452,343.04	28,513,624,404.41
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		25,814,452,343.04	28,411,624,404.41
资产支持证券投资		-	102,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	8,053,851,649.40	7,276,003,833.99
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	324,560,244.72	540,724,267.34
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		75,513,051,210.13	71,406,385,797.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,604,504,357.73	2,227,997,285.00
应付证券清算款		840,781,592.06	1,600,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,979,378.29	16,236,923.13
应付托管费		2,959,144.12	3,006,837.63
应付销售服务费		14,795,720.64	15,034,188.11
应付交易费用	6.4.7.7	371,658.95	361,670.22
应交税费		-	-
应付利息		341,460.60	282,215.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	151,220.26	295,000.00
负债合计		6,479,884,532.65	3,863,214,119.33
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	69,033,166,677.48	67,543,171,677.68
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		69,033,166,677.48	67,543,171,677.68
负债和所有者权益总计		75,513,051,210.13	71,406,385,797.01

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 69,033,166,677.48 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		1,318,851,331.04	1,880,645,669.21
1.利息收入		1,340,531,071.44	1,761,447,885.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	775,364,149.68	1,268,277,517.53
债券利息收入		499,160,917.16	390,764,258.51

资产支持证券利息收入		387,787.82	-
买入返售金融资产收入		65,618,216.78	102,406,109.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,064,740.40	119,123,197.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-6,064,740.40	119,123,197.40
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,615,000.00	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	74,586.00
减：二、费用		251,208,692.76	252,944,965.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	97,024,723.27	96,817,013.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,967,541.32	17,929,076.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	89,837,706.68	89,645,382.99
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		46,112,284.82	48,267,314.11
其中：卖出回购金融资产支出		46,112,284.82	48,267,314.11
6. 其他费用	6.4.7.20	266,436.67	286,178.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,067,642,638.28	1,627,700,703.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,067,642,638.28	1,627,700,703.32

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	67,543,171,677.68	-	67,543,171,677.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	1,067,642,638.28	1,067,642,638.28

期利润)			
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)	1,489,994,999.80	-	1,489,994,999.80
其中：1.基金申购款	160,001,426,366.46	-	160,001,426,366.46
2.基金赎回款	-158,511,431,366.66	-	-158,511,431,366.66
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)	-	-1,067,642,638.28	-1,067,642,638.28
五、期末所有者权益(基金净值)	69,033,166,677.48	-	69,033,166,677.48
项目	上年度可比期间 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)	55,141,438,481.19	-	55,141,438,481.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,627,700,703.32	1,627,700,703.32
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)	15,182,913,043.36	-	15,182,913,043.36
其中：1.基金申购款	339,175,125,779.55	-	339,175,125,779.55
2.基金赎回款	-323,992,212,736.19	-	-323,992,212,736.19
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)	-	-1,627,700,703.32	-1,627,700,703.32
五、期末所有者权益(基金净值)	70,324,351,524.55	-	70,324,351,524.55

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：

庄园芳

基金管理人负责人

杨东

主管会计工作负责人

詹鸿飞

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全添利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2015]217 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 1,306,102,190.00 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(14)第 0174 号验资报告。《兴全添利宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 2 月 27 日正式生效。本基金的管理人为兴业全球基金管理有限公司,托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资范围为以下金融工具:现金、通知存款、短期融资券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、中国证监会认可的其它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同期七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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一致。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、国税函[2008]870 号《关于做好证券市场个人投资者证券交易结算资金利息所得免征个人所得税工作的通知》及其他相关税务法规和实务操作。另，自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内将全面推开营业税改征增值税。主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于增值税征收范围，不缴纳增值税。
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- (3) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	7,043,041,966.79
定期存款	34,277,002,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	11,580,000,000.00
存款期限 1 个月内	1,230,000,000.00
存款期限 3 个月以上	21,467,002,000.00
其他存款	-
合计：	41,320,043,966.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	13,606,755.21	13,615,663.10	8,907.89	0.0000%
	银行间市场	25,800,845,587.83	25,853,681,000.00	52,835,412.17	0.0765%
	合计	25,814,452,343.04	25,867,296,663.10	52,844,320.06	0.0765%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	6,403,114,649.40	-
买入返售证券_交易所	1,650,737,000.00	-
合计	8,053,851,649.40	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	7,238,378.87
应收定期存款利息	69,134,129.91
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	63.50
应收债券利息	240,013,135.88
应收买入返售证券利息	8,174,535.76
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.80

合计	324,560,244.72
----	----------------

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	371,658.95
合计	371,658.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	151,220.26
合计	151,220.26

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,543,171,677.68	67,543,171,677.68
本期申购	160,001,426,366.46	160,001,426,366.46
本期赎回(以“-”号填列)	-158,511,431,366.66	-158,511,431,366.66
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	69,033,166,677.48	69,033,166,677.48

注：申购含红利再投资。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,083,257,638.28	-15,615,000.00	1,067,642,638.28
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,083,257,638.28	15,615,000.00	-1,067,642,638.28
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	86,095,857.62
定期存款利息收入	689,226,698.76
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41,590.89
其他	2.41
合计	775,364,149.68

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,064,740.40
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-6,064,740.40

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	57,746,999,268.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	57,115,422,659.28
减：应收利息总额	637,641,349.50
买卖债券差价收入	-6,064,740.40

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	102,738,413.11
减：卖出资产支持证券成本总额	102,000,000.00
减：应收利息总额	783,413.11
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内未获得股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,615,000.00
——股票投资	-
——债券投资	-15,615,000.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	-15,615,000.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	-
合计	-

6.4.7.19 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	47,738.60
信息披露费	94,481.66
银行汇划费	104,394.39
账户服务费	18,000.00
其他	1,822.02
合计	266,436.67

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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，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	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
兴业证券	13,630,849.83	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	41,983,310,000.00	100.00%	1,411,852,800.00	100.00%

6.4.10.1.4 权证交易

权证不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	97,024,723.27	96,817,013.60
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27%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×0.27%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	17,967,541.32	17,929,076.63

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05%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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业全球基金管理有限公司	89,837,706.68
合计	89,837,706.68
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 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
兴业全球基金管理有限公司	89,645,382.99
合计	89,645,382.99

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
兴业银行	60,123,617.00	-	-	-	1,385,000,000.00	76,660.28
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场 交易的 各关联方名 称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
兴业银行	109,986,269.46	134,625,215.76	-	-	1,167,210,000.00	103,127.62

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	期初持有的基金份额	539,520,095.18
期间申购/买入总份额	636,452,695.71	946,836,816.15
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	550,000,000.00	855,000,000.00
期末持有的基金份额	625,972,790.89	395,137,610.02
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.9068%	0.5619%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

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。

6.4.10.4.2 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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
兴业证券	1,732,098,948.27	2.5091%	719,307,320.80	1.0650%
兴全睿众	23,078,480.65	0.0334%	44,079,012.99	0.0653%
兴业银行	6,622,338,878.28	9.5930%	5,114,670,862.69	7.5724%

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。

6.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	19,843,041,966.79	259,314,135.41	8,311,871,222.46	306,254,481.76

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：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
1,067,642,638.28	-	-	1,067,642,638.28	-

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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为 5,604,504,357.73 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
011599855	15 正泰 SCP003	2016 年 7 月 1 日	100.27	330,000	33,090,275.41
011699008	16 苏交通 SCP001	2016 年 7 月 1 日	100.00	1,100,000	109,999,016.85
011699054	16 珠海华发 SCP001	2016 年 7 月 1 日	99.88	1,700,000	169,791,807.87
011699065	16 重汽 SCP001	2016 年 7 月 1 日	100.07	1,800,000	180,119,253.55
011699121	16 宝钢 SCP001	2016 年 7 月 1 日	100.01	1,000,000	100,014,637.30
011699169	16 苏交通 SCP003	2016 年 7 月 1 日	100.00	2,700,000	269,986,716.02
011699181	16 广州地铁 SCP002	2016 年 7 月 1 日	99.99	2,000,000	199,979,428.46
011699233	16 宝钢股 SCP002	2016 年 7 月 1 日	99.85	3,400,000	339,474,159.29
011699381	16 重汽 SCP002	2016 年 7 月 1 日	99.75	500,000	49,877,286.18
011699479	16 川交投 SCP001	2016 年 7 月 1 日	99.90	1,400,000	139,862,871.16
011699584	16 豫投资 SCP001	2016 年 7 月 1 日	99.89	700,000	69,921,543.82
011699636	16 桂交投 SCP002	2016 年 7 月 1 日	99.80	1,010,000	100,801,817.73
011699648	16 金隅 SCP001	2016 年 7 月 1 日	100.07	2,000,000	200,146,990.98
011699663	16 广州发展 SCP001	2016 年 7 月 1 日	99.73	3,000,000	299,184,015.45
011699666	16 厦门航空 SCP001	2016 年 7 月 1 日	99.92	2,000,000	199,831,170.62
011699673	16 雅砻江 SCP003	2016 年 7 月 1 日	99.96	1,000,000	99,956,230.79
011699722	16 华能新能 SCP003	2016 年 7 月 1 日	99.92	830,000	82,931,464.06
011699729	16 电科院 SCP003	2016 年 7 月 1 日	99.91	1,000,000	99,912,371.38

011699782	16 中材股 SCP001	2016 年 7 月 1 日	99.91	2,500,000	249,769,481.53
011699916	16 闽能源 SCP008	2016 年 7 月 1 日	99.77	360,000	35,917,563.75
041553053	15 广新 CP002	2016 年 7 月 1 日	100.10	800,000	80,078,714.22
041554069	15 宝钢 CP001	2016 年 7 月 1 日	100.39	1,000,000	100,385,795.01
041560062	15 鲁商 CP001	2016 年 7 月 1 日	100.10	620,000	62,060,507.90
041564050	15 申江两 岸 CP001	2016 年 7 月 1 日	100.09	1,200,000	120,104,851.36
041568004	15 天士力 药 CP001	2016 年 7 月 1 日	100.38	450,000	45,169,980.49
041658024	16 中原高 速 CP001	2016 年 7 月 1 日	99.73	500,000	49,866,703.35
041666006	16 深圳水 务 CP001	2016 年 7 月 1 日	99.78	250,000	24,945,811.08
041669017	16 国家核 电 CP001	2016 年 7 月 1 日	99.72	2,500,000	249,288,817.21
070206	07 国开 06	2016 年 7 月 1 日	99.28	3,000,000	297,847,661.35
070208	07 国开 08	2016 年 7 月 1 日	99.19	1,900,000	188,469,067.31
1182247	11 中铝股 MTN1	2016 年 7 月 1 日	100.75	3,330,000	335,501,451.67
120223	12 国开 23	2016 年 7 月 1 日	99.40	2,850,000	283,293,253.09
140201	14 国开 01	2016 年 7 月 1 日	101.44	1,100,000	111,584,568.17
140208	14 国开 08	2016 年 7 月 1 日	101.68	2,500,000	254,208,650.86
140322	14 进出 22	2016 年 7 月 1 日	101.71	2,700,000	274,626,288.87
160304	16 进出 04	2016 年 7 月 1 日	99.62	2,000,000	199,239,593.63
041552044	15 武钢 CP003	2016 年 7 月 1 日	100.24	1,200,000	120,292,231.93
合计				58,230,000	5,827,532,049.70

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的债券、国债、央行票据等，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本

确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,548,041,966.79	18,030,000,000.00	9,742,002,000.00	-	-	-	41,320,043,966.79
结算备付金	141,121.92	-	-	-	-	-	141,121.92
存出保证金	1,884.26	-	-	-	-	-	1,884.26
交易性金融资产	3,521,246,397.28	9,016,859,057.63	13,261,961,888.13	-	-	14,385,000.00	25,814,452,343.04
买入返售金融资产	7,552,690,697.66	501,160,951.74	-	-	-	-	8,053,851,649.40
应收利息	-	-	-	-	-	324,560,244.72	324,560,244.72
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	24,622,122,067.91	27,548,020,009.37	23,003,963,888.13	-	-	338,945,244.72	75,513,051,210.13
负债							
卖出回购金融资产款	5,604,504,357.73	-	-	-	-	-	5,604,504,357.73
应付证券清算款	-	-	-	-	-	840,781,592.06	840,781,592.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,979,378.29	15,979,378.29
应付托管费	-	-	-	-	-	2,959,144.12	2,959,144.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	14,795,720.64	14,795,720.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	371,658.95	371,658.95
应付利息	-	-	-	-	-	341,460.60	341,460.60
其他负债	-	-	-	-	-	151,220.26	151,220.26
负债总计	5,604,504,357.73	-	-	-	-	875,380,174.92	6,479,884,532.65
利率敏感度缺口	19,017,617,710.18	27,548,020,009.37	23,003,963,888.13	-	-	-536,434,930.20	69,033,166,677.48
上年度末 2015年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	10,783,445,196.03	11,005,000,000.00	13,270,000,000.00	-	-	-	35,058,445,196.03
结算备付金	17,588,095.24	-	-	-	-	-	17,588,095.24
交易性金融资	2,254,172,851.84	15,572,641,913.85	10,686,809,638.72	-	-	-	28,513,624,404.41

产							
买入返售金融资产	4,442,308,063.45	2,784,695,577.04	49,000,193.50	-	-	-	7,276,003,833.99
应收利息	-	-	-	-	-	540,724,267.34	540,724,267.34
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,497,514,206.56	29,362,337,490.89	24,005,809,832.22	-	-	540,724,267.34	71,406,385,797.01
负债							
卖出回购金融资产款	2,227,997,285.00	-	-	-	-	-	2,227,997,285.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,600,000,000.00	1,600,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,236,923.13	16,236,923.13
应付托管费	-	-	-	-	-	3,006,837.63	3,006,837.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,034,188.11	15,034,188.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	361,670.22	361,670.22
应付利息	-	-	-	-	-	282,215.24	282,215.24
其他负债	-	-	-	-	-	295,000.00	295,000.00
负债总计	2,227,997,285.00	-	-	-	-	1,635,216,834.33	3,863,214,119.33
利率敏感度缺口	15,269,516,921.56	29,362,337,490.89	24,005,809,832.22	-	-	-1,094,492,566.99	67,543,171,677.68

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2016年6月30日)	上年度末(2015年12月31日)
	利率+1%	-84,349,419.29	-79,276,189.93
	利率-1%	85,127,181.99	79,842,592.56

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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	25,814,452,343.04	34.19
	其中：债券	25,814,452,343.04	34.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	8,053,851,649.40	10.67
	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	41,320,185,088.71	54.72
4	其他各项资产	324,562,128.98	0.43
5	合计	75,513,051,210.13	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	5.76	
	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	5,604,504,357.73	8.12
	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。

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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 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	35.63	9.34
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	20.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	14.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.08	-
5	120 天(含)—397 天(含)	24.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.92	9.34

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

7.5 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	-	-
3	金融债券	2,345,970,985.12	3.40
	其中：政策性金融债	2,345,970,985.12	3.40
4	企业债券	13,606,755.21	0.02
5	企业短期融资券	15,611,270,934.23	22.61
6	中期票据	1,032,628,161.41	1.50
7	同业存单	6,810,975,507.07	9.87
8	其他	-	-
9	合计	25,814,452,343.04	37.39
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	58,551,007.23	0.08

7.6 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

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	111694931	16 重庆农村商行 CD073	10,000,000	992,498,864.60	1.44
2	111692987	16 吉林银行 CD059	5,000,000	498,500,111.17	0.72
3	111692999	16 西安银行 CD009	5,000,000	498,384,436.78	0.72
4	111690916	16 瑞丰银行 CD006	5,000,000	497,397,989.91	0.72
5	111691519	16 广州农村商业银行 CD017	5,000,000	496,571,381.65	0.72
6	1182247	11 中铝股 MTN1	4,200,000	423,154,984.09	0.61
7	011699233	16 宝钢股 SCP002	3,400,000	339,474,159.29	0.49
8	070206	07 国开 06	3,100,000	307,775,916.73	0.45
9	140322	14 进出 22	3,000,000	305,140,320.97	0.44
10	011699663	16 广州发展 SCP001	3,000,000	299,184,015.45	0.43

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1386%
报告期内偏离度的最低值	0.0603%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0970%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内本基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,884.26
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	324,560,244.72
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	324,562,128.98

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比例
930,659	74,176.65	39,729,719,131.30	57.55%	29,303,447,546.18	42.45%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	60,571,612.54	0.0877%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年2月27日）基金份额总额	1,306,102,190.00
本报告期期初基金份额总额	67,543,171,677.68
本报告期基金总申购份额	160,001,426,366.46
减：本报告期基金总赎回份额	158,511,431,366.66
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	69,033,166,677.48
-------------	-------------------

注：总申购份额含红利再投资份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

2016 年 5 月 9 日公告，自 2016 年 5 月 9 日起公司董事长、法定代表人由兰荣先生变更为庄园芳女士；

2016 年 1 月 13 日公告，自 2016 年 1 月 13 日起郑文惠女士任公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金	
------	------	-----------	--

	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
兴业证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 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	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
兴业证券	13,630,849.83	100.00%	41,983,310,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台一亿元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
4	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
5	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 9 日
6	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
7	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台五百万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
8	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日

9	兴全添利宝货币市场基金开通直销柜台转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年2月27日
10	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台一千万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年3月7日
11	关于兴全添利宝货币市场基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年3月17日
12	关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年4月29日
13	关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年5月5日
14	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年5月9日
15	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年5月11日
16	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台两千万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年6月13日
17	关于调整开放式基金开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年6月21日
18	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台四千万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016年6月21日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全添利宝货币市场基金募集注册的文件
- 2、关于募集兴全添利宝货币市场基金之法律意见书
- 3、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 5、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》
- 6、《兴全添利宝货币市场基金托管协议》
- 7、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xyfunds.com.cn>) 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。

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴业全球基金管理有限公司

2016 年 8 月 24 日