

# 兴全添利宝货币市场基金

## 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：2016 年 10 月 26 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 2016 年 10 月 24 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	兴全添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	000575
交易代码	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
报告期末基金份额总额	67,983,102,842.23 份
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
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（2016年7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	485,709,371.11
2. 本期利润	485,709,371.11
3. 期末基金资产净值	67,983,102,842.23

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

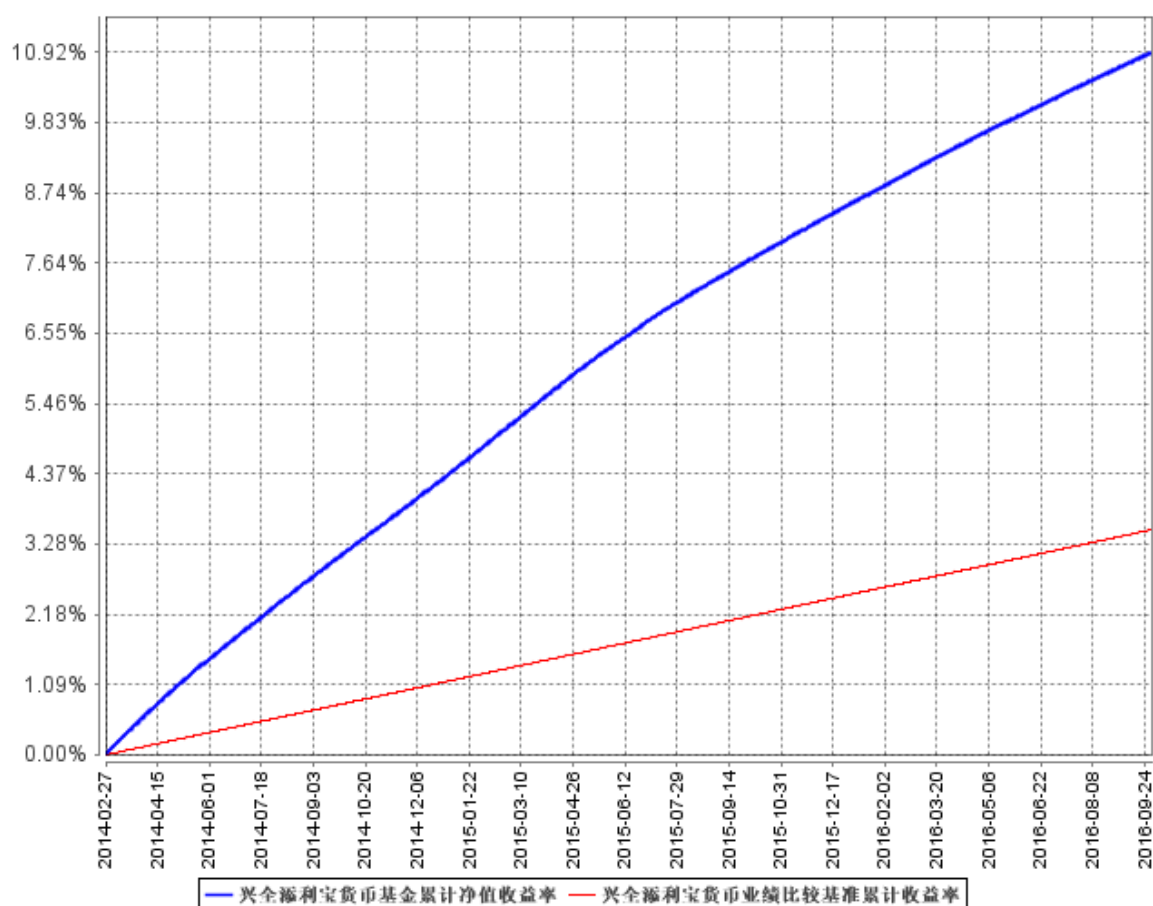
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.6860%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.3457%	0.0010%

注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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 9 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。

## § 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		
钟明	固定收益部总监助理兼本基金、兴全货币市场基金、兴全稳益	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、交易员、基金经理助理。

	债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金经理				
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 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。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 报告期内基金投资策略和运作分析

国际市场上，美国经济数据分化较大，美联储加息一波三折，欧元区内英国脱欧和银行风险事件频发，使得金融市场极其敏感，汇率市场波动加大。人民币在宽松货币政策、实体经济不振的双重打击下，贬值预期也逐渐增强，从年初 6.5 附近下行到目前的 6.7 附近，未来贬值压力仍然不小。国内宏观经济方面，在地产一枝独秀的拉动下，各项经济数据逐渐企稳，PPI 也结束了多年的负值，逐渐转正，但房价的暴涨引发了对地产泡沫的担心，且房价的高企使得原本疲弱的制造业成本进一步上升，更加不利于经济的转型升级。房价的暴涨一方面源于一线城市土地供应量的不足，另一方面也是人民币贬值和宽松货币政策的助力下，居民进行资产配置的逻辑和结果。鉴于此，在一年的地产鼓励性政策后，政府迅速出台了多个城市的限购、限贷政策，给房地产市场降温。金融市场方面，在信心不足的情况下，股市低位窄幅震荡；但是在资产荒、实体经济未出现实质性增长点的情况下，债券市场则突破前期高位，收益率窄幅震荡下行；而在供给侧改革和适度扩大需求的政策叠加下，商品呈现切换式上涨，从钢铁、有色、切换到化工、煤炭。在三去一降一补的宏观调控指引下，一行三会也先后出台了多项规定和征求意见，意在加强金融监管、防范系统性风险，预计未来金融监管仍有可能进一步加强。聚焦到债券市场上，资产收益下行和货币宽松相配合的环境下，金融机构短端加杠杆便成为非常理性的选择，这使得回购融资总量上升到 4.5 万亿之巨，潜在风险引起了监管机构的关注。金融机构高杠杆、叠加日益增强的外汇贬值预期，使得央行的宽松货币政策转向稳健适度，降准降息这种强政策暂停，而 MLF、公开市场等非常规货币工具成为调控的主要手段，金融市场流动性从全面宽松转向间歇式紧张，资金成本有所抬升。在央行宽松货币政策转向稳健适度的预判下，我们采取了较为灵活的配置策略，及时调整大类资产，增强组合流动性，实现了远超基准的收益。

#### 4.5 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为 0.6860%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 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	29,645,999,988.32	38.50
	其中：债券	29,645,999,988.32	38.50

	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,835,677,059.68	10.18
	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	39,201,587,068.38	50.91
4	其他资产	322,561,181.03	0.42
5	合计	77,005,825,297.41	100.00

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	9.44	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,911,691,812.44	5.75
	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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

### 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没有发生超过 120 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	31.03	13.22
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.04	-
2	30 天(含)-60 天	17.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60 天(含)-90 天	27.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.29	-
4	90 天(含)-120 天	7.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.13	-
5	120 天(含)-397 天(含)	29.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	112.79	13.22

#### 5.4 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。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,410,603,024.47	3.55
	其中：政策性金融债	2,410,603,024.47	3.55
4	企业债券	37,866,765.17	0.06
5	企业短期融资券	13,814,697,777.78	20.32
6	中期票据	1,367,867,879.99	2.01
7	同业存单	12,014,964,540.91	17.67
8	其他	-	-
9	合计	29,645,999,988.32	43.61
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	318,188,440.04	0.47

#### 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)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111696021	16 广州银行 CD060	5,000,000	498,601,133.35	0.73
2	111614141	16 江苏银行 CD141	5,000,000	498,396,380.45	0.73
3	111696048	16 西安银行 CD035	5,000,000	498,365,374.63	0.73
4	111696452	16 广东南粤银行 CD083	5,000,000	497,916,101.38	0.73
5	111691092	16 泉州银行 CD016	5,000,000	493,089,799.73	0.73
6	111695711	16 温州银行 CD099	5,000,000	486,785,135.32	0.72
7	111610534	16 兴业 CD534	5,000,000	485,633,599.11	0.71



8	111696915	16 江苏江南农村商业银行 CD114	4,000,000	394,642,562.13	0.58
9	111695812	16 绍兴银行 CD050	4,000,000	389,388,213.98	0.57
10	111696584	16 常熟农村商行 CD068	3,500,000	348,353,470.21	0.51

## 5.7 “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	0.1205%
报告期内偏离度的最低值	0.0819%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1079%

### 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。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1

本基金估值采用摊余成本法（除特殊情况外），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。

### 5.9.2

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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,764.24
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	322,550,416.79
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	322,561,181.03

#### 5.9.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	69,033,166,677.48
报告期期间基金总申购份额	79,102,360,282.13
报告期期间基金总赎回份额	80,152,424,117.38
报告期期末基金份额总额	67,983,102,842.23

注：总申购份额含红利再投资。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2016年7月5日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
2	申购	2016年7月6日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
3	申购	2016年7月7日	30,000,000.00	30,000,000.00	-
4	赎回	2016年7月11日	-50,000,000.00	-50,000,000.00	-
5	赎回	2016年7月14日	-12,000,000.00	-12,000,000.00	-
6	赎回	2016年7月20日	-53,000,000.00	-53,000,000.00	-
7	赎回	2016年7月22日	-60,000,000.00	-60,000,000.00	-
8	赎回	2016年7月25日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
9	赎回	2016年7月29日	-16,000,000.00	-16,000,000.00	-
10	红利再投	2016年7月31日	1,413,744.67	1,413,744.67	-
11	申购	2016年8月3日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
12	申购	2016年8月4日	32,000,000.00	32,000,000.00	-
13	赎回	2016年8月11日	-35,000,000.00	-35,000,000.00	-
14	赎回	2016年8月15日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	-
15	赎回	2016年8月16日	-5,000,000.00	-5,000,000.00	-
16	赎回	2016年8月19日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-

17	申购	2016 年 8 月 24 日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
18	申购	2016 年 8 月 25 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
19	红利再投	2016 年 8 月 31 日	1,367,497.17	1,367,497.17	-
20	赎回	2016 年 8 月 31 日	-5,000,000.00	-5,000,000.00	-
21	申购	2016 年 9 月 2 日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
22	申购	2016 年 9 月 5 日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
23	申购	2016 年 9 月 6 日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
24	申购	2016 年 9 月 7 日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
25	申购	2016 年 9 月 8 日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
26	申购	2016 年 9 月 13 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
27	赎回	2016 年 9 月 19 日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	-
28	赎回	2016 年 9 月 21 日	-205,000,000.00	-205,000,000.00	-
29	申购	2016 年 9 月 25 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
30	申购	2016 年 9 月 28 日	45,000,000.00	45,000,000.00	-
31	红利再投	2016 年 9 月 30 日	1,516,507.02	1,516,507.02	-
<b>合计</b>			<b>3,297,748.86</b>	<b>3,297,748.86</b>	

注：1、“交易日期”为交易确认日或分红权益登记日。

2、因本基金收益分配按日结转份额，上表中“红利再投资”数据为当月汇总数据。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

## 9.3 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。

兴业全球基金管理有限公司  
2016 年 10 月 26 日