

兴全添利宝货币市场基金

2015 年第 3 季度报告

2015 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：2015 年 10 月 24 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 2015 年 10 月 22 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 2015 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	96,527,144,196.17 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（2015年7月1日—2015年9月30日）
1. 本期已实现收益	858,700,341.19
2. 本期利润	858,700,341.19
3. 期末基金资产净值	96,527,144,196.17

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

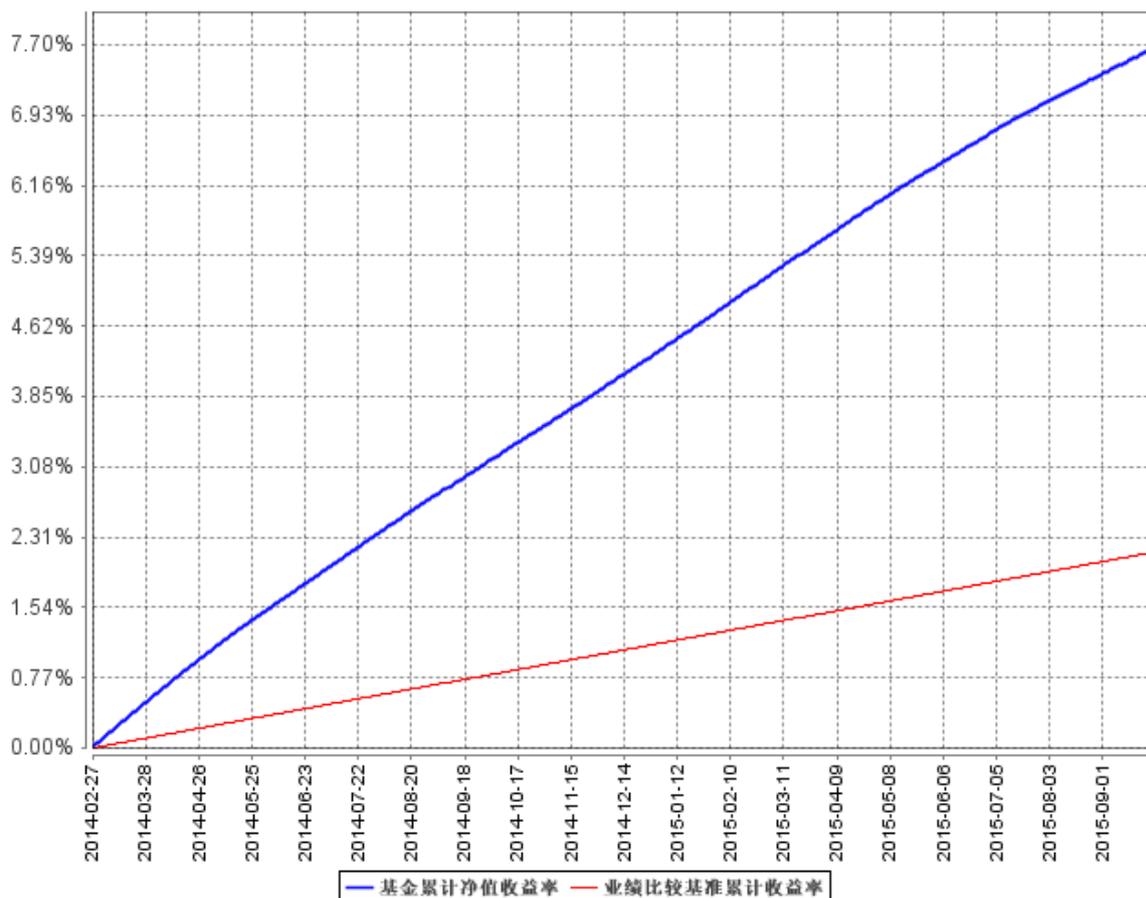
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.8984%	0.0014%	0.3403%	0.0000%	0.5581%	0.0014%

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

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 2015 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		
张睿	本基金基金经理	2014 年 2 月 27 日	-	10 年	经济学硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴业全球基金管理有限公司

					司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理。
钟明	本基金、兴全货币市场基金和兴全稳益债券型证券投资基金基金经理	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。
毛水荣	-	2014 年 6 月 10 日	2015 年 7 月 10 日	-	-

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。管理人于 2015 年 8 月 3 日收到上海证监局发出的《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求对人员行为和异常交易加强日常管理。管理人已积极整改。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

三季度期间，从基本面看，在全球经济放缓、国内需求不振的环境下，各项核心经济数据继续下行，传统周期性行业还是没有摆脱产能过剩、价格下行的状态；尽管食品价格有阶段性反弹，整体通胀水平依然处于低位。从资产配置看，权益市场的动荡、新股发行暂停助推了避险情绪和机构对固定收益资产的配置力度，无风险利率基准有所下行。从货币政策看，央行除了继续采用降息降准等利率工具、数量化工具外，还进一步推进了外汇市场的报价机制改革，导致人民币兑美元汇率短期内出现较大幅度的贬值，以应对资金外流压力和经济下行压力。整体而言，经济基本面和资金面对债市形成了较强支撑，银行间市场的资金面继续保持宽松状态，资金成本保持在低位水平徘徊。对资金面的宽松预期使得市场较为热衷于套息策略，债市杠杆逐渐增加。运作期内，受益于低资金成本和基本面数据疲弱，收益率曲线经历了平坦化下行，长端下行幅度大于短端。然而随着经济下行，部分企业面临的经营环境和财务压力继续恶化，鉴于此，本组合操作上加强了对信用敞口的控制，增加了存款的配置力度，将久期保持在适度水平，总体收益保持平稳和相对较高的水平。

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为 0.8984%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

考虑到近期政府对经济刺激力度加大，先后出台了汽车、地产等利好政策，信贷数据也出现阶段性好转，且数据面临着去年下半年的低基数效应，虽然中期经济仍在筑底，但四季度经济无论是预期、还是实际都存在环比小幅改善的可能。流动性方面，随着贬值预期减弱，资金外流压力正在减小。展望四季度，预计央行仍会保持相对宽松的货币政策以应对基本面，预计 R007 处于 2.5% 的中枢附近。在此背景下，债市预计将保持平稳运行。策略上，我们将以绝对收益和相对利差为标准，在优先个券和信用研究的基础上，继续配置具有相对价值的现券；择优配置存款和存单，力争保持平稳和相对较高的收益水平。

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	32,449,567,591.90	32.79
	其中：债券	32,329,567,591.90	32.67
	资产支持证券	120,000,000.00	0.12
2	买入返售金融资产	5,818,294,887.44	5.88
	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	59,954,781,819.58	60.58
4	其他资产	741,766,476.74	0.75
5	合计	98,964,410,775.66	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	2.23	
	其中：买断式回购融资	0.00	
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	2,389,996,075.00	2.48
	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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78
-------------------	----

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没有发生超过 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	29.78	2.48
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	19.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	7.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	25.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.06	-
5	180 天(含)-397 天(含)	20.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	101.80	2.48

5.4 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	4,130,614,196.71	4.28
	其中：政策性金融债	4,130,614,196.71	4.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	14,886,641,327.58	15.42
6	中期票据	3,191,633,105.48	3.31
7	同业存单	10,120,678,962.13	10.48
8	其他	-	-
9	合计	32,329,567,591.90	33.49
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	58,213,369.00	0.06

5.5 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	111510315	15 兴业 CD315	20,000,000	1,966,871,500.12	2.04
2	111511245	15 平安 CD245	10,000,000	983,176,039.12	1.02
3	111519064	15 恒丰银行 CD064	10,000,000	982,700,373.36	1.02
4	111513112	15 浙商 CD112	10,000,000	982,508,781.78	1.02
5	111591888	15 宁波银行 CD108	10,000,000	973,726,453.25	1.01
6	111519063	15 恒丰银行 CD063	6,000,000	589,792,698.46	0.61
7	150413	15 农发 13	5,800,000	579,450,789.25	0.60
8	150403	15 农发 03	5,600,000	562,129,529.29	0.58
9	041453118	14 酒钢 CP002	5,500,000	551,268,499.65	0.57
10	011574004	15 陕煤化 SCP004	5,000,000	499,907,635.47	0.52

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1836%
报告期内偏离度的最低值	0.1000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1297%

5.7 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

序号	债券代码	债券名称	数量（份）	期末市值	占基金资产净值比例（%）
1	1589152	15 恒金 1A1	1,200,000	120,000,000.00	0.12

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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，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	41,910,693.70
3	应收利息	699,855,783.04
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	741,766,476.74

5.8.5 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	70,324,351,524.55
报告期期间基金总申购份额	142,065,902,822.89
减：报告期期间基金总赎回份额	115,863,110,151.27
报告期期末基金份额总额	96,527,144,196.17

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情况**7.1 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	2015年7月2日	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
2	申购	2015年7月6日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%

3	赎回	2015 年 7 月 7 日	-65,000,000.00	-65,000,000.00	0.00%
4	申购	2015 年 7 月 9 日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
5	赎回	2015 年 7 月 13 日	-28,000,000.00	-28,000,000.00	0.00%
6	赎回	2015 年 7 月 15 日	-13,000,000.00	-13,000,000.00	0.00%
7	申购	2015 年 7 月 22 日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
8	赎回	2015 年 7 月 28 日	-27,000,000.00	-27,000,000.00	0.00%
9	赎回	2015 年 7 月 30 日	-29,000,000.00	-29,000,000.00	0.00%
10	红利再投	2015 年 7 月 31 日	1,344,131.61	1,344,131.61	0.00%
11	申购	2015 年 8 月 5 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
12	申购	2015 年 8 月 6 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
13	申购	2015 年 8 月 7 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
14	申购	2015 年 8 月 10 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
15	申购	2015 年 8 月 11 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
16	申购	2015 年 8 月 12 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
17	申购	2015 年 8 月 13 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
18	申购	2015 年 8 月 14 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
19	申购	2015 年 8 月 18 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
20	申购	2015 年 8 月 31 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
21	红利再投	2015 年 8 月 31 日	1,184,153.41	1,184,153.41	0.00%
22	申购	2015 年 9 月 2 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
23	申购	2015 年 9 月 8 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
24	申购	2015 年 9 月 9 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
25	申购	2015 年 9 月 10 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
26	申购	2015 年 9 月 11 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
27	申购	2015 年 9 月 14 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
28	申购	2015 年 9 月	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%

		15 日			
29	申购	2015 年 9 月 16 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
30	申购	2015 年 9 月 17 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
31	申购	2015 年 9 月 18 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
32	申购	2015 年 9 月 21 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
33	申购	2015 年 9 月 22 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
34	申购	2015 年 9 月 23 日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
35	红利再投	2015 年 9 月 30 日	1,307,932.96	1,307,932.96	0.00%
合计			96,836,217.98	96,836,217.98	

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

2015 年 10 月 24 日