

国投瑞银添利宝货币市场基金2015年年度报告

2015年12月31日

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年3月28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。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3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。

本报告期自2015年4月23日（基金合同生效日）起至12月31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	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6	审计报告	17
6.1	审计报告基本信息	17
6.2	审计报告的基本内容	17
§7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	22
§8	投资组合报告	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2	债券回购融资情况	43
8.3	基金投资组合平均剩余期限	43
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合	44
8.5	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	44
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	45
8.7	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	45
8.8	投资组合报告附注	45
§9	基金份额持有人信息	46
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	47
9.3	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情况	47
§10	开放式基金份额变动	48
§11	重大事件揭示	48
11.1	基金份额持有人大会决议	48

11.2	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	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4	基金投资策略的改变	49
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	50
11.9	其他重大事件	50
§12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国投瑞银添利宝货币市场基金	
基金简称	国投瑞银添利宝货币	
基金主代码	001094	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月23日	
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	284,160,357.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国投瑞银添利宝货币A	国投瑞银添利宝货币B
下属分级基金的交易代码	001094	001095
报告期末下属分级基金的份 额总额	654,078.81份	283,506,278.80份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以基金资产安全性、流动性为先，并力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要采用流动性管理策略、资产配置策略，并适当利用交易策略，进行积极的投资组合管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于债券型基金、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		国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	刘凯	洪渊
	联系电话	400-880-6868	010-66105799

电子邮箱	service@ubssdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-880-6868	95588
传真	0755-82904048	010-66105798
注册地址	上海市虹口区东大名路638号7层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518035	100140
法定代表人	叶柏寿	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	http://www.ubssdic.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	国投瑞银基金管理有限公司	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年4月23日至2015年12月31日	
	国投瑞银添利宝货币A	国投瑞银添利宝货币B
本期已实现收益	813,682.94	2,064,769.41
本期利润	813,682.94	2,064,769.41

本期净值收益率	1.9238%	1.8706%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	
期末基金资产净值	654,078.81	283,506,278.80
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2015年末	
累计净值收益率	1.9238%	1.8706%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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、本基金根据每日基金收益情况以每万份基金收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

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 (国投瑞银添利宝货币 A)	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
过去三个月	0.7429 %	0.0012 %	0.3456 %	0.0000 %	0.3973 %	0.0012 %
过去六个月	1.4209 %	0.0011 %	0.6924 %	0.0000 %	0.7285 %	0.0011 %
自基金合同生效日起 至今	1.9238 %	0.0015 %	0.9532 %	0.0000 %	0.9706 %	0.0015 %

阶段 (国投瑞银添利宝货币 B)	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
过去三个月	0.7429	0.0012	0.3456	0.0000	0.3973	0.0012

	%	%	%	%	%	%
过去六个月	1.4209	0.0011	0.6924	0.0000	0.7285	0.0011
	%	%	%	%	%	%
自基金合同生效日起至今	1.8706	0.0012	0.9040	0.0000	0.9666	0.0012
	%	%	%	%	%	%

注：1、本基金的业绩比较基准中，通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期7天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。根据财政部、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（财税〔2008〕132号）文件规定，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。故本基金本报告期以税前七天通知存款利率为业绩比较基准。

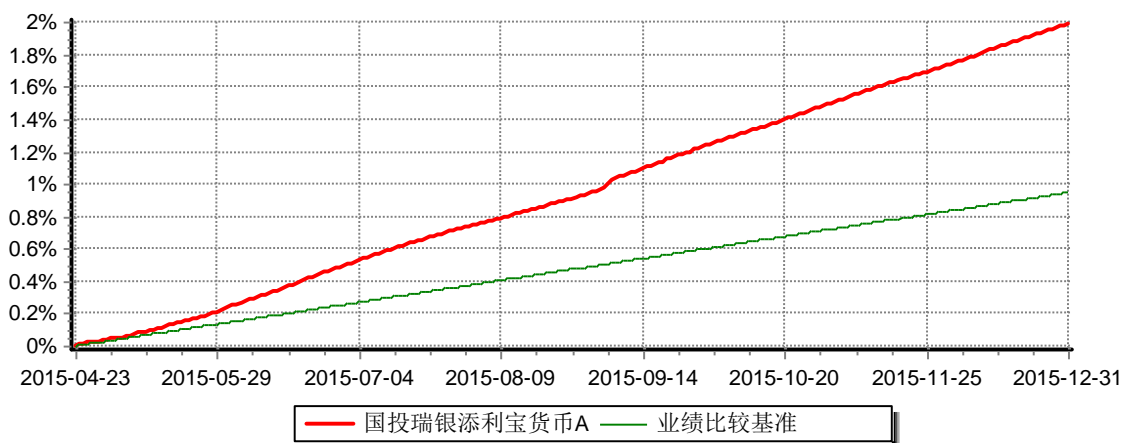
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3、本基金基金合同生效日为2015年4月23日，其中添利宝B类基金份额自2015年5月6日起开始运作且开放申购赎回。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

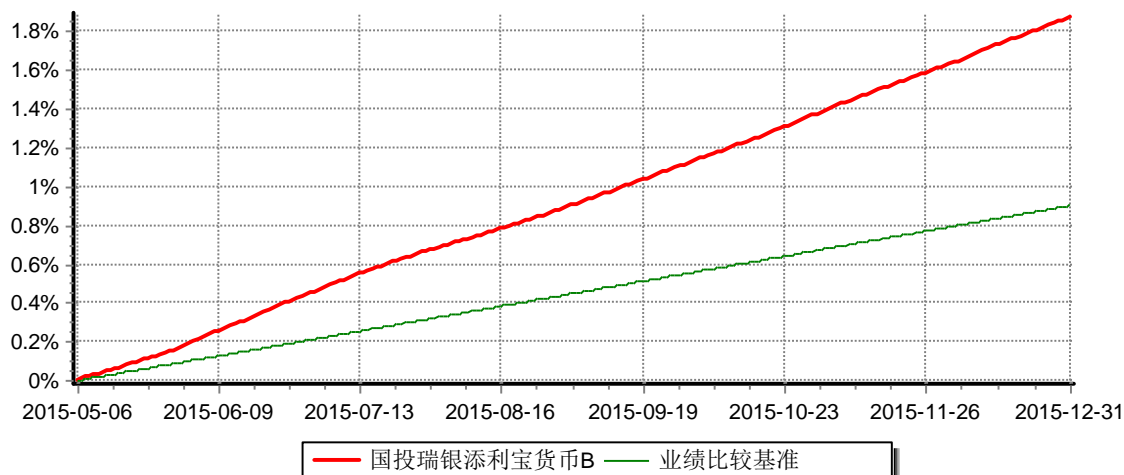
国投瑞银添利宝货币A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年4月23日-2015年12月31日)



国投瑞银添利宝货币B

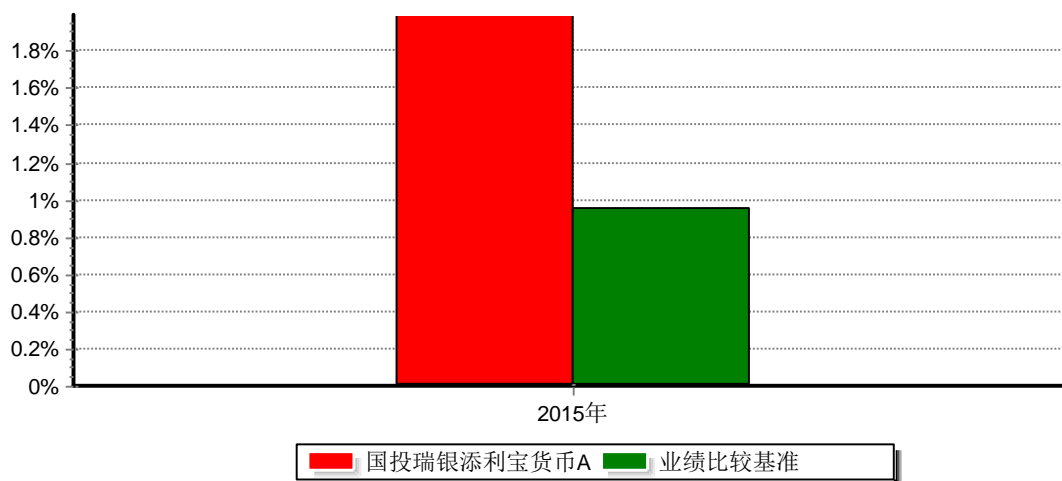
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年4月23日-2015年12月31日)

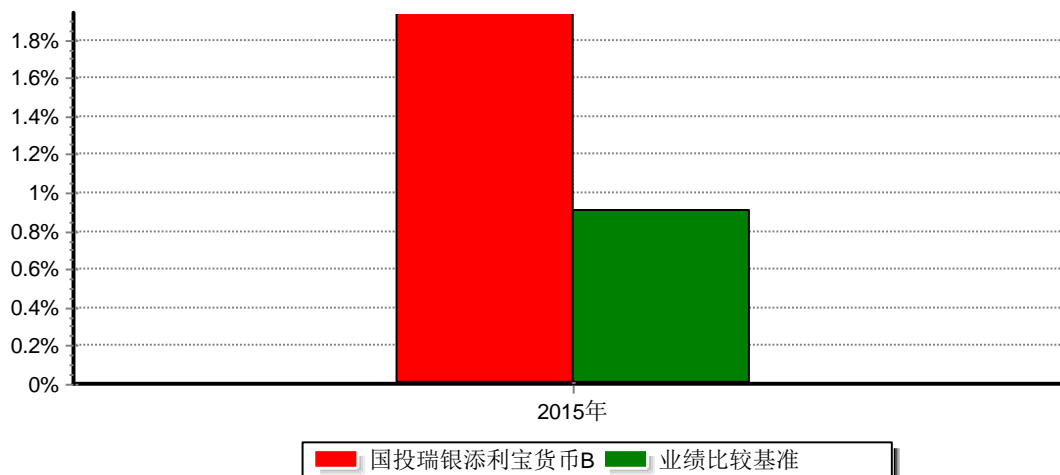


注：1、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至本报告期末，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

2、本基金基金合同生效日为2015年04月23日，其中添利宝B类基金份额自2015年5月6日起开始运作且开放申购赎回。截至本报告期末，本基金运作时间未满一年。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同于2015年04月23日生效，其中添利宝B类基金份额自2015年5月6日起开始运作且开放申购赎回。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

国投瑞银添利宝货币A

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2015年	813,682.94	—		813,682.94	
合计	813,682.94	—		813,682.94	

国投瑞银添利宝货币B

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2015年	2,064,769.41			2,064,769.41	
合计	2,064,769.41			2,064,769.41	

§ 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

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于2002年6月13日正式成立，注册资本1亿元人民币。公司是中

国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司，公司股东为国投泰康信托有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构，建立了有效的风险管理及控制架构，以“诚信、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止2015年12月底，公司有员工207人，其中118人具有硕士或博士学位；公司管理53只基金，其中包括2只创新型分级基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
颜文浩	本基金基金经理	2015年4月23日	—	6	中国籍，硕士，具有基金从业资格。2010年10月加入国投瑞银。现任国投瑞银钱多宝货币基金、国投瑞银增利宝货币基金和国投瑞银添利宝货币基金基金经理。

注：任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银添利宝货币市场基金基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，忠实尽职的原则，为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策规范，基金运作合法合规，没有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 公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度，并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则：

- 1、当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时，坚持基金持有人利益优先；
- 2、当不同资产委托人利益发生冲突时，应公平的对待不同的资产委托人；
- 3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合；

4、严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下：

1、不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程，提高投资管理的科学性和客观性，确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2、公平交易的范围覆盖所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，同时涵盖研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3、合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4、建立科学的投资决策体系，加强交易分配的内部控制，通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现，同时通过监察稽核，事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下：

1、以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统，充分发挥系统的自动控制功能，根据公平交易管理的要求，在系统中设置相应业务流转顺序、控制阈值或者触发机制，对触及阈值的行为视情况分别采取警告、强制禁止等控制措施或对特定业务自动执行必要的后续流程。如：符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易，内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理，控制阈值的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并点击同意才能生效等。

2、以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动，通过建立明确的业务规则和流程，在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制，通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求，实现对关键业务风险的管理。如：以公司名义进行的一级市场申购结果分配，需要经过严格的公平性审核，由交易部负责人、运营部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后才为有效。

3、以日常监控为督促手段。公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位，分别在交易过程中、日中、清算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控，并按既定的报告要求及时揭示违反规定的情况，监督督促公平交易制度的执行。如：交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督，监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素和签署情况的检查等。

4、以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核，监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理

的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。通过事后的专项稽核和定期分析，发现控制薄弱环节或交易价异常，将重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度和流程。

5、加强信息披露和接受外部监督。公司在各投资组合的定期报告中，披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明，接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查，公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时，将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会向证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况，并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明。公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题，也将在向证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式，也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析，并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为，将依法采取相关监管措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，形成了有效地公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合同向交易成交价格均值的溢价率是否趋近于零进行T检验，检验在95%的可信水平下，价格均值的溢价率趋近于零是否存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况，

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年受房地产投资增速下行拖累，中国经济全年呈现逐季下行趋势；为平缓经济下行压力，央行多次下调存款基准利率及存款准备金率，降低实体经济融资成本。在宽货币政策推动下，债市市场短端收益率大幅下行；以一年期AAA级短融为例，从年初4.72%下行至年末2.87%。全年，货币基金总体保持较长剩余期限，获得了较好的资本利得回报；同时严控投资风险，保证组合资产安全。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A级份额净值增长率为1.9238%，同期业绩比较基准收益率为0.9532%，B级份额净值增长率为1.8706%，同期业绩比较基准收益率为0.9040%。本期内基金份额净值增长率高于基准，主要由于本基金较好地把握了市场机会，在收益率下行过程中保持相对较高的债券配置比例。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年，依据当前经济持续下行、人民币贬值压力增强的宏观背景，我们预计央行会继续保持市场资金面适度宽松，但短期资金价格继续走低的概率正在降低。结合目前收益率曲线及未来资金价格走势，货币基金将保持适中的组合久期，提高组合资产的流动性及安全性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人高度重视风险控制，充分发挥监察稽核工作的作用，提高监察稽核工作的有效性，为公司业务规范运作提供保证和支持，确保公司的业务运作能切实贯彻执行法律、法规和公司内控制度。本基金管理人充分意识到投资业务规范化的重要性，秉承瑞银集团重视风险重视管理的风控风格：“将风险纳入全面、系统的管理流程中，以风险管理促业务发展”，建立和完善风险管理体系，应用国际先进的风险管理系统，在公司实行多层次全方位的风险管理，围绕业务风险点建立事前、事中、事后的风险控制措施，除开展日常的控制和监督工作外，本年度还重点安排对投资管理、公平交易管理以及研究支持、投资决策、交易执行等核心业务的管理工作开展专项自查，并对其它相关业务也安排了定期检查或专项审计，力争使公司的管理措施健全、有效。

本基金管理人对公司投资管理等重要业务实行事前、事中和事后全程监督，多环节

控制，分别示例介绍如下：

事前审查审核：充分利用信息系统，将有关法律法规、基金合同和公司规定的各种投资禁止、投资限制和量化监控指标在交易系统中进行阈值设置，基金投资如果超出限制，系统将拒绝执行指令并及时报警；在公司办公系统中建立研究报告质量控制、股票出入库调整、交易对手授信、询价、一级市场申购、投资授权、重大决策等常规性投研交相关的流程控制措施，明确审核人员以及审核责任，相关业务必须经过预先规定的审批程序后才能执行；非常规性的业务，由合规与风险控制委员会按一事一议的集体决策方式确定业务风险以及控制措施后执行；基金合同、招募说明书（更新）、基金定期报告、临时报告及基金宣传材料等对外披露信息文稿，在上报核准和对外发布前必须经过监察稽核部、信息披露负责人和督察长的合法合规性审查。

事中实时监控：交易部设立实时监控岗位，按照法律法规以及公司规定结合投资决策委员会、监察稽核部等确定的控制要求，对基金经理的投资指令进行执行前的审查，发现违法违规和越权行为，有权拒绝执行并及时报告监察稽核部、督察长；监察稽核部借助自行开发的盘中监控系统对基金当日投资交易行为进行监控，并借助办公系统中的业务审批流程，对基金投资的关键环节实行实时监控；运营部门也按照事先确定的规则对银行间、一级市场等特殊交易行为进行监控，并执行异常问题的及时报告机制。

事后检查督促：交易部每日对当日交易行为进行总结和报告，相关交易结果由基金经理进行确认；运营部结合每日估值结果对投资超标等行为进行提示；监察稽核部采取现场与非现场稽核结合，并以现场稽核为主的方式对基金投资进行检查。非现场稽核主要是通过计算机系统定期对期间内的交易行为进行稽查，从中分析是否有违规交易行为。现场稽核主要是对公司各业务环节进行定期的例行检查和专项检查，并对主要业务部门及重点业务环节进行不定期的突击检查，发现问题及时报告并监督整改。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估，并对基金估值程序进行监督；估值小组负责跟踪现行估值政策、议定估值政策方案及特别估值程序的报告等事项，估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金经理或其他资产管理经理以及监察稽核部指定人员；运营部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策，设立基金估值核算员岗位负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关成员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行、运营部内部复核估值结果，并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制，基金经理作为估值小组成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值小组提供估值参考信息，参与估值政策讨论。对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由估

值小组讨论议定特别估值方案并与托管行沟通，在上报合规与风险控制委员会审议后由运营部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益。

本基金国投瑞银添利宝货币A本期已实现收益为813,682.94元，国投瑞银添利宝货币B本期已实现收益为2,064,769.41元，已全部在每日通过利润分配方式分配完毕。

报告期本基金的利润分配符合法律法规的相关规定和《基金合同》的约定。

4.9 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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对国投瑞银添利宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，国投瑞银添利宝货币市场基金的管理人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银添利宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制和披露的国投瑞银添利宝货币市场基金2015年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2016)审字第60469016_H22号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国投瑞银添利宝货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的国投瑞银添利宝货币市场基金的财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表、2015年4月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国投瑞银基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关</p>

	<p>的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国投瑞银添利宝货币市场基金2015年12月31日的财务状况以及2015年4月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日的经营成果和净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	昌 华，高 鹤
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2016-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国投瑞银添利宝货币市场基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	160,316,423.66
结算备付金		152,380.95
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	112,656,983.98
其中：股票投资		—

基金投资		—
债券投资		112,656,983.98
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	9,800,134.70
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	1,332,344.83
应收股利		—
应收申购款		50,000.00
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		284,308,268.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		74,063.56
应付托管费		11,221.75
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	3,625.20
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—

其他负债	7.4.7.8	59,000.00
负债合计		147,910.51
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	284,160,357.61
未分配利润	7.4.7.10	—
所有者权益合计		284,160,357.61
负债和所有者权益总计		284,308,268.12

注：（1）报告截止日2015年12月31日，国投瑞银添利宝货币市场基金A类基金份额净值人民币1.000元，国投瑞银添利宝货币市场基金B类基金份额净值人民币1.000元，基金份额总额284,160,357.61份；其中国投瑞银添利宝货币市场基金A类基金份额654,078.81份，国投瑞银添利宝货币市场基金B类基金份额283,506,278.80份。

（2）本基金合同生效日为2015年4月23日，2015年度实际报告期间为2015年4月23日至2015年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：国投瑞银添利宝货币市场基金

本报告期：2015年4月23日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年4月23日至2015年12月31日
一、收入		3,628,656.74
1. 利息收入		3,370,132.50
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,379,611.99
债券利息收入		751,463.36
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		239,057.15
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,231.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—

基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	29,231.42
资产支持证券投资收 益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	—
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.16	—
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.17	229,292.82
减：二、费用		750,204.39
1. 管理人报酬		345,370.80
2. 托管费		52,328.96
3. 销售服务费		261,644.53
4. 交易费用	7.4.7.18	—
5. 利息支出		5,208.36
其中：卖出回购金融资产支出		5,208.36
6. 其他费用	7.4.7.19	85,651.74
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		2,878,452.35
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		2,878,452.35

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：国投瑞银添利宝货币市场基金

本报告期：2015年4月23日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年4月23日至2015年12月31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）	250,675,802.75	—	250,675,802.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		2,878,452.35	2,878,452.35
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）	33,484,554.86	—	33,484,554.86
其中：1. 基金申购款	1,203,922,589.05	—	1,203,922,589.05
2. 基金赎回款	-1,170,438,034.19	—	-1,170,438,034.19
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）	—	-2,878,452.35	-2,878,452.35
五、期末所有者权益（基金净值）	284,160,357.61	—	284,160,357.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王彬

王彬

冯伟

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国投瑞银添利宝货币市场基金（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”）证监许可[2015] 223号文《关于准予国投瑞银添利宝货币市场基金注册的批复》的核准，由基金管理人国投瑞银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年4月23日正式生效，首次设立募集规模为250,675,802.75份基金份额。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司，注册登记机构为国投瑞银基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

本基金主要投资于以下金融工具：现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）

的银行定期存款和大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券（国债、金融债、公司债、企业债、次级等债）、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）的中期票据、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持券以及中国证监会、中国人民银行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七天通知存款利率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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并发布的《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2015年4月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年4月23日（基金合同生效日）起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产分类为交易性金融资产及应收款项；

本基金持有的交易性金融资产主要为债券投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为交易性金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目；应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格(附注7.4.4.5)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

(1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息。

(2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

(3) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息。

基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

(4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过0.50%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，同时编制并披露临时报告。

(6) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为人民币1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率逐日计提；

(3) 基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3、“每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

4、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益；

5、本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，其当日净收益大于零时，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；若当日净收益小于零时，相应缩减投资者基金份额；

6、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7、已获得赎回T+0款项支付服务的基金份额遵循下述原则：当基金T日净收益大于零时，该部分基金份额不再享有上述基金份额自T日起产生的投资收益，该部分收益归入基金资产。当基金T日净收益小于零时，该部分基金份额应承担上述基金份额T日产生的亏损，基金管理人有权向上述投资者追索该部分亏损；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、企业所得税

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入，免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.2 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税；

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	3,316,423.66

定期存款	157,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	132,000,000.00
存款期限1个月以内	10,000,000.00
存款期限3个月-1年	15,000,000.00
其他存款	—
合计	160,316,423.66

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2015年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	112,656,983.98	112,838,500.00	181,516.02	0.0639
	合计	112,656,983.98	112,838,500.00	181,516.02	0.0639

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	9,800,134.70	—
交易所市场		
合计	9,800,134.70	

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	802.75
应收定期存款利息	634,093.04
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	68.60
应收债券利息	690,117.94
应收买入返售证券利息	7,262.50
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	1,332,344.83

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	3,625.20
合计	3,625.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—

预提审计费	50,000.00
银行间债券帐户维护费	9,000.00
预提信息披露费	
合计	59,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 国投瑞银添利宝货币A

金额单位：人民币元

项目	2015年4月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	250,675,802.75	250,675,802.75
本期申购	30,217,591.91	30,217,591.91
本期赎回（以“-”号填列）	-280,239,315.85	-280,239,315.85
本期末	654,078.81	654,078.81

7.4.7.9.2 国投瑞银添利宝货币B

金额单位：人民币元

项目	2015年4月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	—	—
本期申购	1,173,704,997.14	1,173,704,997.14
本期赎回（以“-”号填列）	-890,198,718.34	-890,198,718.34
本期末	283,506,278.80	283,506,278.80

注：1）本基金合同于2015年4月23日生效。首次发售募集的有效认购资金认购金额为人民币250,649,345.78元，折合250,649,345.78份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币26,456.97元，折合26,456.97份基金份额。其中A类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金认购金额为人民币250,649,345.78元，折合250,649,345.78份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币26,456.97元，折合26,456.97份基金份额。B类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金认购金额为人民币0.00元，折合0.00份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币0.00元，折合0.00份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币250,675,802.75元，折合250,675,802.75份基金份额。

(2) 本期申购包含红利再投、基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 国投瑞银添利宝货币A

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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	813,682.94	—	813,682.94
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	-813,682.94	—	-813,682.94
本期末	—	—	—

7.4.7.10.2 国投瑞银添利宝货币B

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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	2,064,769.41	—	2,064,769.41
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	-2,064,769.41	—	-2,064,769.41
本期末	—	—	—

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月23日至2015年12月31日
活期存款利息收入	40,589.06
定期存款利息收入	2,337,352.75

其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	1,670.18
其他	—
合计	2,379,611.99

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月23日至2015年12月31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	29,231.42
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	29,231.42

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月23日至2015年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	8,167,025.64
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	8,008,931.27
减：应收利息总额	128,862.95
买卖债券差价收入	29,231.42

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月23日至2015年12月31日
基金赎回费收入	—
其他收入	229,292.82
基金转换费收入	
合计	229,292.82

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月23日至2015年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	—
银行汇划费用	17,351.74
银行间账户维护费	18,000.00
其他费用	300.00
合计	85,651.74

7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
国投泰康信托有限公司	基金管理人的股东
瑞士银行股份有限公司	基金管理人的股东
国投瑞银资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
国投瑞银资本管理有限公司	基金管理人的子公司

注：（1）于本报告期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

（2）以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年4月23日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	345,370.80
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：（1）基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

（2）于2015年12月31日的应付基金管理费为人民币74,063.56元。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年4月23日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	52,328.96

注：（1）基金托管费每日计提，按月支付。基金托管人的基金托管费按基金财产净值的0.05%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金财产净值

（2）于2015年12月31日的应付基金托管费为人民币11,221.75元。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015年4月23日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国投瑞银添利宝货币A	国投瑞银添利宝货币B	合计
国投瑞银基金管理有限公司	32,351.71	—	32,351.71

中国工商银行			
合计	32,351.71	—	32,351.71

注：（1）销售服务费每日计提，按月支付。本基金的销售服务费年费率为0.25%的年费率逐日计提。销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times \text{基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金财产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 2015年4月23日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,316,423.66	40,589.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

国投瑞银添利宝货币A

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
813,682.94	—	—	813,682.94	

国投瑞银添利宝货币B

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
2,064,769.41	—	—	2,064,769.41	

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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/增发证券而于年末流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，投资于货币市场工具，包括：现金、通知存款、短期融资券、1年以内（含1年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限在397天以内（含397天）的债券（国债、金融债、公司债、企业债、次级债等）、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）的中期票据、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的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。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理念，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规与风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行工商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。其他定期存款存放在具有托管资格的交通银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、平安银行股份有限公司及上海浦东发展银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。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；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2015年12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为33.31%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年12月31日
A-1	19,986,526.70
A-1以下	—
未评级	87,669,918.06
合计	107,656,444.76

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票和部分短期融资券。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年12月31日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	5,000,539.22
合计	5,000,539.22

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债、央票。
3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人持续进行本基金的流动性需求分析，构建投资组合时，对备选证券进行流动性检验，并以适度分散策略保持组合流动性，严格控制缺乏流动性资产的比例。同时通过独立的风险管理部门设定基金的流动性比例控制要求，对现金类资产配置策略、证券集中度、重仓证券的流动性以及冲击成本率、换手率和交易活跃度等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。于本期末，基金未持有流通受限的资产，所持资产均能及时变现。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投资的公允价值。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人执行灵活的利率管理策略规避利率风险，借鉴瑞银全球资产管理公司海外管理经验，结合自主开发的估值系统管理利率风险，通过收益率利差分析、静态利差分析和期权调整利差等分析，计算组合证券的修正久期、利差久期、有效久期和有效凸性的风险控制指标，跟踪调整投资组合的久期和凸性等利率风险衡量指标，控制组合的利率风险。当预期债券市场利率下降时，加大固定利率证券的配置比例；当预期债券市场利率上升时，加大浮息证券的配置比例。通过改变浮息和固息证券的配置比例，控制证券投资组合的久期，防范利率风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债都计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金持有的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	38,316,423.66	112,000,000.00	10,000,000.00	—	—	—	160,316,423.66
结算备付金	152,380.95	—	—	—	—	—	152,380.95
交易性金融资产	5,000,539.22	22,846,383.87	84,810,060.89	—	—	—	112,656,983.98
买入返售金融资产	9,800,134.70	—	—	—	—	—	9,800,134.70
应收利息	—	—	—	—	—	1,332,344.83	1,332,344.83
应收申购款	50,000.00	—	—	—	—	—	50,000.00
资产总计	53,319,423.66	134,846,383.87	94,810,060.89	—	—	1,332,344.83	284,308,212.25

	478.53	,383.87	060.89			44.83	,268.12
负债							
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	74,063. 56	74,063. 56
应付托管费	—	—	—	—	—	11,221. 75	11,221. 75
应付交易费 用	—	—	—	—	—	3,625.2 0	3,625.2 0
其他负债	—	—	—	—	—	59,000. 00	59,000. 00
负债总计	—	—	—	—	—	147,910 .51	147,910 .51
利率敏感度 缺口	53,319, 478.53	134,846 ,383.87	94,810, 060.89	—	—	1,184,4 34.32	284,160 ,357.61

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配

置、投资组合进行修正，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

于2015年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资，本基金管理人已充分评估当除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月25日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	112,656,983.98	39.62
	其中：债券	112,656,983.98	39.62
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	9,800,134.70	3.45
	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	160,468,804.61	56.44
4	其他各项资产	1,382,344.83	0.49
5	合计	284,308,268.12	100.00

8.2 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	0.14	
	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	—	—

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日融资余额占基金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

本报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天。本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

8.3.2 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	18.69	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—

2	30天(含)–60天	16.89	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)–90天	30.56	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)–180天	12.26	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)–397天(含)	21.10	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.51	—

8.4 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	18,005,808.36	6.34
	其中：政策性金融债	18,005,808.36	6.34
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	64,959,029.76	22.86
6	中期票据	—	—
7	同业存单	29,692,145.86	10.45
8	其他	—	—
9	合计	112,656,983.98	39.65
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

8.5 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	150215	15国开15	100,000	10,000,582.45	3.52
2	0115998 41	15陕煤化 SCP008	100,000	9,996,024.05	3.52
3	0415690 43	15中冶CP002	100,000	9,991,451.76	3.52
4	0115150 08	15中铝业 SCP008	100,000	9,991,012.43	3.52
5	1115113 26	15平安CD326	100,000	9,925,693.10	3.49
6	1115112 49	15平安CD249	100,000	9,916,004.08	3.49
7	1115930 96	15杭州银行 CD103	100,000	9,850,448.68	3.47
8	130206	13国开06	50,000	5,000,539.22	1.76
9	0115810 04	15淮南矿 SCP004	50,000	4,999,400.81	1.76
10	0115997 36	15锡产业 SCP005	50,000	4,998,407.63	1.76

8.6 “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	0.0780
报告期内偏离度的最低值	-0.0054
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0235

8.7 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
本基金本期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

8.8.2

本基金本报告期内无剩余期限小于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的20%的情况

8.8.3

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	1,332,344.83
4	应收申购款	50,000.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	1,382,344.83

8.8.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
国投瑞 银添利 宝货币A	151	4,331.65	9,547.57	1.46%	644,531.24	98.54%
国投瑞 银添利 宝货币B	10,505	26,987.75	—	—	283,506,27 8.80	100.00%
合计	10,656	26,666.70	9,547.57	—	284,150,81 0.04	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	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 有本开放式基金	国投瑞银添利 宝货币A	166,939.52	25.52%
	国投瑞银添利 宝货币B	—	—
	合计	166,939.52	0.06%

9.3 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情况

项目	份额级别	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	国投瑞银添 利宝货币A	0
	国投瑞银添 利宝货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	国投瑞银添 利宝货币A	0~10

	国投瑞银添利宝货币B	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国投瑞银添利宝货币A	国投瑞银添利宝货币B
基金合同生效日(2015年4月23日)基金份额总额	250,675,802.75	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	30,217,591.91	1,173,704,997.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	280,239,315.85	890,198,718.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	654,078.81	283,506,278.80

注：1、本基金基金合同生效日为2015年4月23日，其中添利宝B类基金份额自2015年5月6日起开始运作且开放申购赎回。

2、总申购份额含红利再投份额、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、袁野先生自2015年9月9日起任管理人副总经理。
- 2、袁野先生自2015年10月19日起兼任国投瑞银资本副总经理。

另，刘纯亮先生自2016年2月3日起不再任管理人总经理，王彬女士接任管理人总经理；包爱丽女士自2016年2月3日起不再任管理人副总经理。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金合同生效，基金投资策略未发生变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金合同生效，初次聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。报告期内应支付给该事务所的报酬为50,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占股票成交总额比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例
安信证券	3	—	—	—	—	6,000,000.00	2.39%	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	131,700,000.00	52.39%	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	14,000,000.00	5.57%	—	—
东北证	1	—	—	—	—	10,000,	3.98	—	—

券						000.00	%		
东方证 券	1	—	—	—	—	9,000,0 00.00	3.58 %	—	—
国海证 券	1	—	—	—	—	5,000,0 00.00	1.99 %	—	—
国金证 券	1	—	—	—	—	5,000,0 00.00	1.99 %	—	—
国信证 券	2	—	—	—	—	20,000, 000.00	7.96 %	—	—
海通证 券	2	—	—	—	—	21,200, 000.00	8.43 %	—	—
平安证 券	1	—	—	—	—	6,000,0 00.00	2.39 %	—	—
信达证 券	1	—	—	—	—	5,000,0 00.00	1.99 %	—	—
浙商证 券	1	—	—	—	—	11,000, 000.00	4.38 %	—	—
中信建 投	2	—	—	—	—	7,500,0 00.00	2.98 %	—	—

注：1、本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。根据董事会授权，由公司执行委员会批准。

2、本报告期本基金未发生交易所股票、债券和权证交易。

3、本基金报告期内合同生效，上述租用交易单元均为本期新增租用。

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

报告期内基金无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

11.9 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	关于本基金基金合同生效的公告	《证券日报》	2015-04-24
2	关于本基金开放日常申购、赎回、	《证券日报》	2015-04-29

	定期定额投资及转换业务的公告		
3	关于网上直销转账汇款买基金减免认、申购费的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-06-01
4	关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-07-06
5	关于本基金暂停/恢复申购(转换转入、大额定期定额投资)的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-08-31
6	关于基金行业高级管理人员变更的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-09-10
7	关于本基金暂停/恢复申购(转换转入、大额定期定额投资)的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-09-25
8	关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职的公告	《证券时报》	2015-10-24
9	关于调整货币基金快速赎回限额的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-11-24
10	关于调整货币基金快速赎回限额的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-12-07
11	关于调整货币基金快速赎回限额的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-12-16
12	关于网上直销转账汇款买基金减免认、申购费的公告	《中国证券报》 《证券时报》 《上海证券报》	2015-12-26
13	关于指数熔断实施期间调整旗下	《中国证券报》	2015-12-31

	相关基金开放时间的公告	《证券时报》 《上海证券报》	
--	-------------	-------------------	--

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

《关于准予国投瑞银添利宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2015]223号）

《关于国投瑞银添利宝货币市场基金备案确认的函》（机构部函[2015]1095号）

《国投瑞银添利宝货币市场基金基金合同》

《国投瑞银添利宝货币市场基金托管协议》

国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

国投瑞银添利宝货币市场基金2015年年度报告原文

12.2 存放地点

中国广东省深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

存放网址：<http://www.ubssdic.com>

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

咨询电话：国投瑞银基金管理有限公司客户服务热线 400-880-6868

国投瑞银基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日