

# 兴全添利宝货币市场基金

## 2016 年第 1 季度报告

2016 年 3 月 31 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 4 月 21 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 4 月 20 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 1 月 1 日起至 3 月 31 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	72,358,373,048.90 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1月1日—2016年3月31日）
1. 本期已实现收益	569,879,858.91
2. 本期利润	554,264,858.91
3. 期末基金资产净值	72,358,373,048.90

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。

#### 3.2 基金净值表现

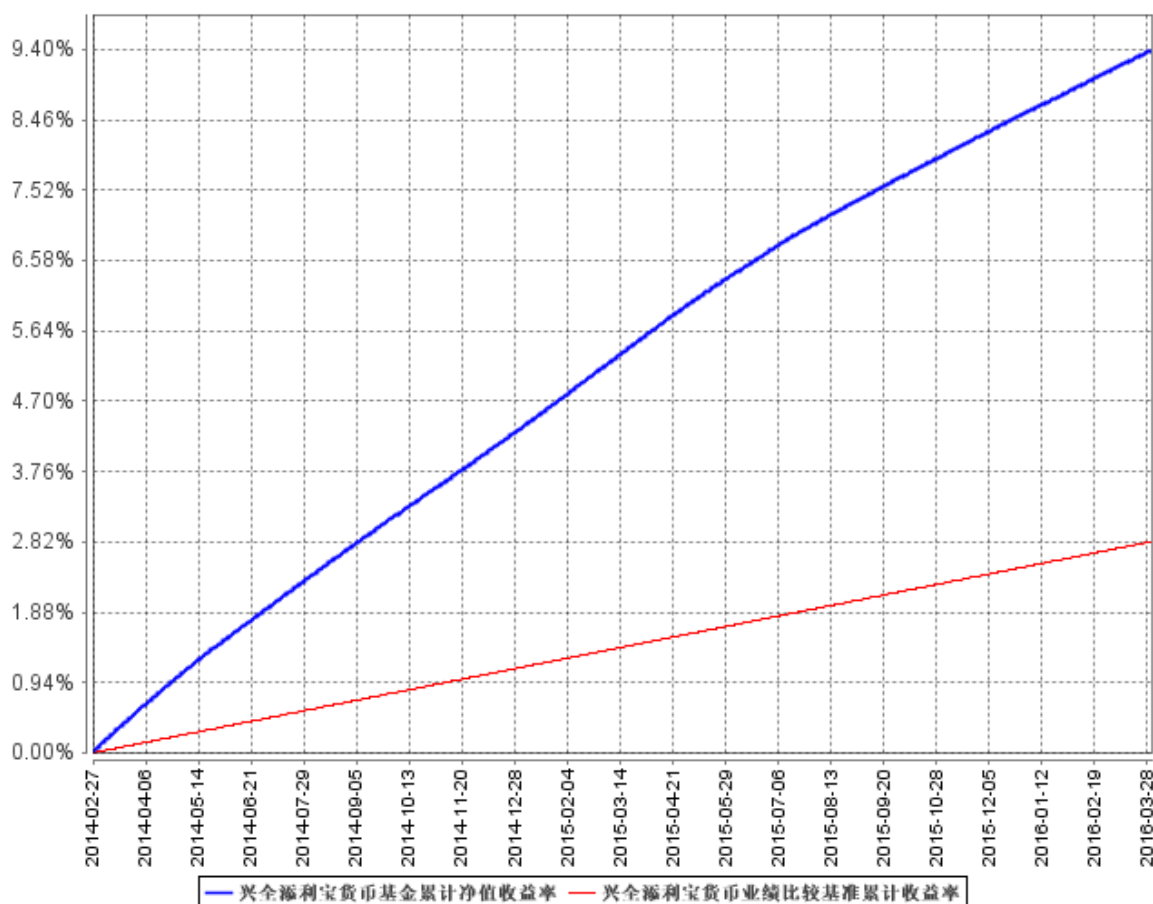
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.7725%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.4359%	0.0012%

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 3 月 31 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	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。

	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				
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。
张睿	-	2014 年 2 月 27 日	2016 年 3 月 17 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

随着 2015 年央行的多次宽松政策后，金融体系内流动性充裕，但是实体经济由于结构性问题的存在，下行压力依然存在，由此导致的贬值预期引起了外汇占款的大额持续流出，从而对货币政策形成了掣肘。此外，一月份的超预期信贷规模叠加春节效应对银行间的流动性形成了较大的压力，资金利率的波动区间有所放大。而随着信贷数据放量、地产的回暖，经济底部企稳的预期渐浓，债券市场也出现了小幅调整。不过配置资金的旺盛需求导致期限利差和信用利差均处于历史低位。运作期内，本基金规模保持了基本稳定，适时增加了存款和存单的配置比例，按照新的货币法规要求，适度增加了高评级债券的配置比例。

##### 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 0.7725%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，联储推迟加息，人民币贬值预期有所减弱；国内则受益于地产回暖、补库存周期和基建托底，部分经济指标企稳回升。但目前经济并未产生新的经济增长点，短期的基建政策托底有余而向上弹性不足，经济好转后需求侧刺激或将再次让位于供给侧改革，经济中期下行压力仍存。市场方面，信用债和利率债走势的驱动因素分化将持续一段时间：理财资金的配置行为和基本面下行是过去一段时间内债券市场整体走牛的主要因素，但是向前看，理财的对信用债的配置行为将依然活跃，经济回暖的持续性对利率债的影响则需要等待被验证。近期不断出现的违约事件将逐渐成为市场关注的焦点，信用利差或将走阔来反映逐渐上升的违约风险；与此同时，防风险下的监管态度也将影响债市的走势。展望未来，在经济内生增长未能企稳前，预计偏宽松的货币政策不会转向，我们对短端利率仍保持中性乐观态度。

#### 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	26,829,163,569.75	33.37
	其中：债券	26,829,163,569.75	33.37
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,621,783,692.65	5.75
	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	48,487,828,727.14	60.31
4	其他资产	454,850,674.14	0.57
5	合计	80,393,626,663.68	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	6.48	
	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	7,998,214,060.06	11.05
	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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	56

### 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	40.43	11.05

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	19.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	30.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	17.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.08	-
5	180 天(含)-397 天(含)	2.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	110.48	11.05

#### 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	2,868,187,919.91	3.96
	其中：政策性金融债	2,868,187,919.91	3.96
4	企业债券	80,446,183.69	0.11
5	企业短期融资券	9,728,887,679.38	13.45
6	中期票据	1,634,584,350.64	2.26
7	同业存单	12,517,057,436.13	17.30
8	其他	-	-
9	合计	26,829,163,569.75	37.08
10	剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债券	58,434,073.32	0.08

#### 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	111591888	15 宁波银行 CD108	6,000,000	594,942,226.65	0.82
2	150413	15 农发 13	5,800,000	579,682,068.13	0.80
3	150311	15 进出 11	5,000,000	499,683,003.22	0.69
4	111692023	16 广州银行 CD026	5,000,000	498,890,255.06	0.69
5	111692042	16 洛阳银行 CD024	5,000,000	498,870,831.04	0.69



6	111690893	16 富滇银行 CD005	5,000,000	497,646,816.23	0.69
7	111691311	16 广东南粤银行 CD031	5,000,000	496,987,678.28	0.69
8	111691573	16 广州农村商业银行 CD019	5,000,000	496,924,722.61	0.69
9	111691521	16 东莞农村商业银行 CD031	5,000,000	496,756,662.92	0.69
10	111691581	16 洛阳银行 CD013	5,000,000	496,665,760.27	0.69

## 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	0.1386%
报告期内偏离度的最低值	0.0887%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1184%

## 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

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

除特殊情况外，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。

### 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。

### 5.8.4 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	-
3	应收利息	450,979,737.50
4	应收申购款	3,870,936.64
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	454,850,674.14

### 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	67,543,171,677.68
报告期期间基金总申购份额	91,411,358,827.60
减：报告期期间基金总赎回份额	86,596,157,456.38
报告期期末基金份额总额	72,358,373,048.90

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	2016年1月5日	65,000,000.00	65,000,000.00	-
2	申购	2016年1月7日	100,000,000.00	100,000,000.00	-
3	赎回	2016年1月11日	-45,000,000.00	-45,000,000.00	-
4	赎回	2016年1月13日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	-
5	赎回	2016年1月15日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
6	赎回	2016年1月22日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
7	申购	2016年1月26日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
8	申购	2016年1月27日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
9	红利再投资	2016年1月	1,482,403.46	1,482,403.46	-

		31 日			
10	赎回	2016 年 2 月 4 日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
11	申购	2016 年 2 月 16 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
12	申购	2016 年 2 月 17 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
13	申购	2016 年 2 月 18 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
14	申购	2016 年 2 月 19 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
15	申购	2016 年 2 月 22 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
16	申购	2016 年 2 月 23 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
17	申购	2016 年 2 月 24 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
18	申购	2016 年 2 月 25 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
19	申购	2016 年 2 月 26 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
20	申购	2016 年 2 月 29 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
21	红利再投资	2016 年 2 月 29 日	1,640,806.71	1,640,806.71	-
22	申购	2016 年 3 月 1 日	3,000,000.00	3,000,000.00	-
23	申购	2016 年 3 月 3 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
24	申购	2016 年 3 月 4 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
25	申购	2016 年 3 月 7 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
26	申购	2016 年 3 月 8 日	5,000,000.00	5,000,000.00	-
27	申购	2016 年 3 月 9 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
28	申购	2016 年 3 月 10 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
29	申购	2016 年 3 月 11 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
30	申购	2016 年 3 月 14 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
31	申购	2016 年 3 月 15 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
32	申购	2016 年 3 月 16 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
33	申购	2016 年 3 月 17 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
34	申购	2016 年 3 月	10,000,000.00	10,000,000.00	-

		18 日			
35	申购	2016 年 3 月 21 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
36	申购	2016 年 3 月 22 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
37	申购	2016 年 3 月 23 日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
38	申购	2016 年 3 月 24 日	8,000,000.00	8,000,000.00	-
39	赎回	2016 年 3 月 30 日	-2,000,000.00	-2,000,000.00	-
40	红利再投资	2016 年 3 月 31 日	1,870,501.76	1,870,501.76	-
合计			248,993,711.93	248,993,711.93	

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 4 月 21 日