

**兴业添天盈货币市场基金2016年年度报告摘要**

**2016年12月31日**

**基金管理人：兴业基金管理有限公司**

**基金托管人：交通银行股份有限公司**

**送出日期：2017年3月31日**

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	兴业添天盈货币	
基金主代码	001624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月23日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,308,268,814.88份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
下属分级基金的交易代码	001624	001625
报告期末下属分级基金的份 额总额	20,890.07份	10,308,247,924.81份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保证基金资产的安全性和流动性的前提下，通过主动式管理，力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量方法，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定当期收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：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	兴业基金管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	朱玮	陆志俊
	联系电话	021-22211888	95559
	电子邮箱	renjb@cib-fund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40000-95561	95559
传真		021-22211997	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## §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	2016年		2015年7月23日-2015年12月31日	
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
本期已实现收益	624.69	283,389,051.08	141.75	25,994,048.32
本期利润	624.69	283,389,051.08	141.75	25,994,048.32
本期净值收益率	2.5744%	2.8265%	0.7007%	0.8090%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末	
期末基金资产净值	20,890.07	10,308,247,924.81	17,539.90	10,025,286,247.03
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本基金收益分配按日结转份额。

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、本基金基金合同于2015年7月23日生效，可比报告期不是完整报告期。

### 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 (兴业添天盈货币A)	份额净值收益	份额净值收益	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
------------------	--------	--------	--------	--------	-----	-----

	率①	率标准 差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	0.6814 %	0.0018 %	0.3393 %	0.0000 %	0.3421 %	0.0018 %
过去六个月	1.3420 %	0.0016 %	0.6787 %	0.0000 %	0.6633 %	0.0016 %
过去一年	2.5744 %	0.0020 %	1.3500 %	0.0000 %	1.2244 %	0.0020 %
自基金合同生效日起 至今	3.2932 %	0.0026 %	1.9492 %	0.0000 %	1.3440 %	0.0026 %

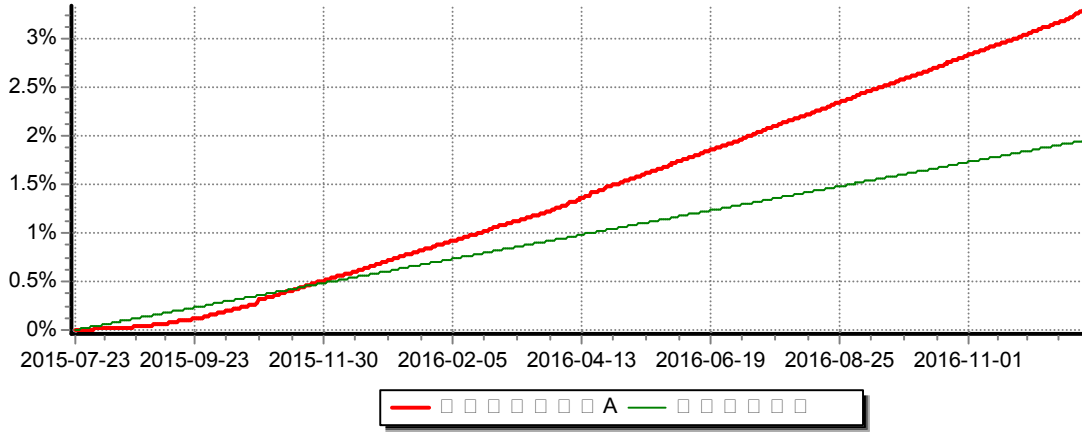
注：本基金收益分配为按日结转份额。

阶段 (兴业添天盈货币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	0.7408 %	0.0017 %	0.3393 %	0.0000 %	0.4015 %	0.0017 %
过去六个月	1.4620 %	0.0016 %	0.6787 %	0.0000 %	0.7833 %	0.0016 %
过去一年	2.8265 %	0.0019 %	1.3500 %	0.0000 %	1.4765 %	0.0019 %
自基金合同生效日起 至今	3.6585 %	0.0026 %	1.9492 %	0.0000 %	1.7093 %	0.0026 %

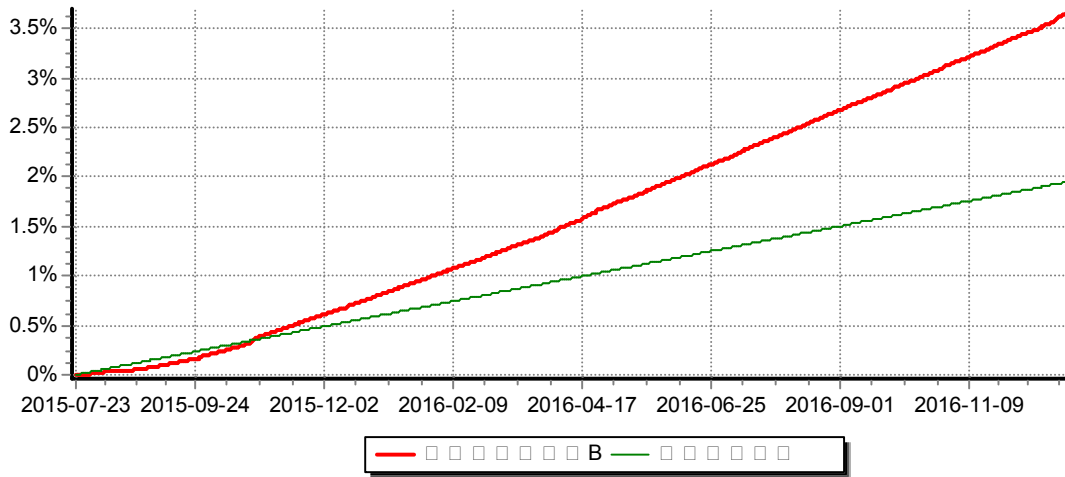
注：本基金收益分配为按日结转份额。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

兴业添天盈货币A份额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



兴业添天盈货币B份额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

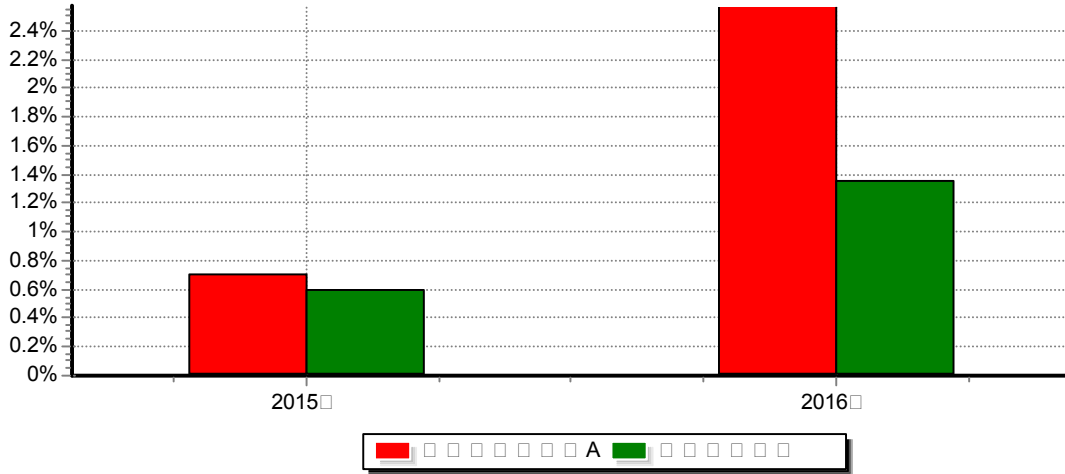


注：1、本基金于2015年7月23日成立。

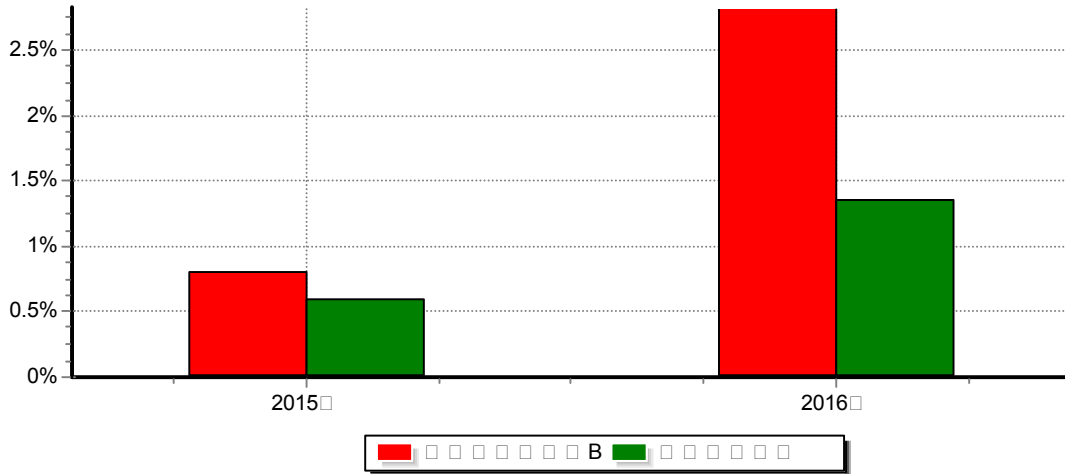
2、根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

兴业添天盈货币A基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



兴业添天盈货币B基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比如图



注：本基金基金合同于2015年7月23日生效，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

兴业添天盈货币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
2016年	623.64	—	1.05	624.69	
2015年	140.63	—	1.12	141.75	
合计	764.27	—	2.17	766.44	

兴业添天盈货币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
2016年	282,961,677.78	—	427,373.30	283,389,051.08	
2015年	25,286,247.03	—	707,801.29	25,994,048.32	
合计	308,247,924.81	—	1,135,174.5 9	309,383,099.40	

## § 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

2013年3月，兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海集团投资有限公司共同出资设立，公司注册资本7亿元人民币，注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2016年12月31日，兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业保本混合型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金。

#### 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		
徐莹	本基金的基金经理	2015年7月23日	—	8	中国籍，硕士学位，CFA，具有证券投资基金从业资格。2008年7月至2012年5月，在兴业银行总行资金营运中心从事债券交易、债券投资；2012年5月至2013年6月，在兴业银行总行资产管理部从事组合投资管理；2013年6月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
杨逸君	本基金的基金经理	2015年11月9日	—	6	中国籍，硕士学位，金融风险管理师（FRM），具有证券投资基金从业资格。2010年7月至2013年6月，在海富通基金管理有限公司主要从事基金产品及证券市场研究分析工作；2013年6月至2014年5月在建信基金管理有限公司主要从事基金产品及量化投资相关的研究分析工作；2014年5月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金

合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 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

2016年经济总体保持平稳增长，经济L型延续，尤其是第三季度后回升势头有所加快，通胀压力有所上升。从货币市场情况看，5月以前，受央行降准预期差、地方债专项金融债供给冲击、MPA考核及信用事件等因素影响，货币市场维持紧平衡；此后资金市场维持宽松格局；第三季度以来，国内经济基本利好因素不断显现，外围受美国加息靴子落地以及美国总统大选、意大利公投失败等黑天鹅事件影响，主要发达国家国债收益率大幅上行，人民币贬值压力持续攀升，国内货币政策边际收紧，债市"去杠杆"背景下，央行公开市场"锁短放长"，对利率波动弹性容忍度增加，叠加债市黑天鹅、货基赎回等因素，造成国内债券及资金市场大幅调整。报告期内，维持较低的信用债配置比例，谨慎进行杠杆操作，年内适当增加了同业存单的配置比例，在年末债市大幅调整阶段，为了避免组合负偏离情况进一步扩大，对组合内存单进行部分减持，增加存款等资产配置，力争在保证流动性的前提下提高组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金A类份额净值收益率为2.5744%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%，本基金B类份额净值收益率为2.8265%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

### 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2017年，从国际上看，全球经济总体呈现复苏态势，部分发达经济体增长可能加快，但仍面临复杂多变的国际环境，如国际政治经济社会领域的“黑天鹅”事件可能增多，民粹主义和逆全球化的影响可能加大，主要发达国家货币政策外溢效应影响存在不确定性等。从国内经济看，2016年三季度以来经济和通胀有阶段性的回升，但此轮基于补库存周期与供给侧改革下的经济内生增长动力及持续性存在不确定性，表现在：工业企业利润短期改善，但产能过剩未有根本性好转；房地产行业景气度可能会对经济动能形成牵制；基建投资受制于财政扩张空间有限，需PPP、专项金融债等融资工具助力；受收入增速下滑及实际利率影响，消费增速或维持偏稳定或小幅下滑；在中国出口占比较高、全球贸易保护抬头等背景下，出口空间增长有限。通胀短升长降，面临供给侧改革节奏与油价等不确定因素影响，人民币汇率贬值压力继续存在。货币政策方面，预计在经济不存在明显下行压力的情况下将维持稳健中性，以控风险和防控资产价格泡沫为主。资金方面，虽然广义流动性充裕，但在外部美联储加息等长期因素叠加，内部政策“去杠杆”、MPA考核以及资管政策出台等因素影响下，未来短期性、结构性流动性紧张将延续，利率波动将进一步上升。在此背景下，我们对2017年上半年债券市场持中性谨慎态度，将密切关注央行监管政策的变化以及外围美元周期带来的影响，在警惕流动性以及信用风险的大前提下，采取较为稳健的操作策略，短久期债券提供流动性，长久期债券跟随市场节奏博取收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任；委员若干名，由基金运营部、风险管理总部、研究部、投资管理总部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

###### (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司

采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，按日进行支付。报告期内本基金向A级份额持有人分配利润624.69元，向B级份额持有人分配利润283,389,051.08元。

#### 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

本报告期内，本基金不存在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

2016年度，基金托管人在兴业添天盈货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016年度，兴业基金管理有限公司在兴业添天盈货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：624.69元，向B级份额持有人分配利润：283,389,051.08元。

### 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

2016年度，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有兴业添天盈货币市场基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

本报告期基金财务报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴业添天盈货币市场基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,288,102,142.53	6,630,002,115.78
结算备付金	—	574,310,000.00
存出保证金	—	—
交易性金融资产	8,470,039,250.24	1,715,358,103.50
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	8,266,548,203.37	1,200,814,345.34
资产支持证券投资	203,491,046.87	514,543,758.16
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	605,424,788.15	1,080,002,620.00
应收证券清算款	—	—
应收利息	38,523,035.64	28,570,066.25
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	10,402,089,216.56	10,028,242,905.53

负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>负 债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	89,099,746.35	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	2,353,828.32	1,650,194.17
应付托管费	435,894.13	305,591.51
应付销售服务费	87,182.99	61,121.91
应付交易费用	70,858.29	14,408.60
应交税费	—	—
应付利息	228,714.84	—
应付利润	1,135,176.76	707,802.41
递延所得税负债	—	—
其他负债	409,000.00	200,000.00
负债合计	93,820,401.68	2,939,118.60
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	10,308,268,814.88	10,025,303,786.93
未分配利润	—	—
所有者权益合计	10,308,268,814.88	10,025,303,786.93
负债和所有者权益总计	10,402,089,216.56	10,028,242,905.53

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.00元，基金份额总额10,308,268,814.88份，其中A类基金份额20,890.07份，B类基金份额10,308,247,924.81份。

2、本基金合同于2015年7月23日生效，2015年度数据按实际存续期计算。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业添天盈货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间2015年 7月23日至2015年12月 31日
<b>一、收入</b>	328,032,281.39	29,710,595.54
1.利息收入	327,280,857.30	29,383,377.85
其中：存款利息收入	91,540,959.36	17,438,569.30
债券利息收入	197,073,639.64	3,466,722.87
资产支持证券利息收入	22,379,992.51	2,328,134.85
买入返售金融资产收入	16,286,265.79	6,149,950.83
其他利息收入	—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）	591,055.56	327,217.69
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	734,673.07	348,131.99
资产支持证券投资收益	-143,617.51	-20,914.30
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
股利收益	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	160,368.53	—
<b>减：二、费用</b>	44,642,605.62	3,716,405.47
1. 管理人报酬	27,436,311.82	2,869,178.22
2. 托管费	5,080,798.44	531,329.26
3. 销售服务费	1,016,216.98	106,287.99
4. 交易费用	300.00	—
5. 利息支出	10,633,856.70	—
其中：卖出回购金融资产支出	10,633,856.70	—

6. 其他费用	475,121.68	209,610.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	283,389,675.77	25,994,190.07
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	283,389,675.77	25,994,190.07

注：本基金合同于2015年7月23日生效，2015年度数据按实际存续期计算。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业添天盈货币市场基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	10,025,303,786.93	—	10,025,303,786.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		283,389,675.77	283,389,675.77
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）	282,965,027.95	—	282,965,027.95
其中：1.基金申购款	283,289,893.23	—	283,289,893.23
2.基金赎回款	-324,865.28	—	-324,865.28
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）	—	283,389,675.77	-283,389,675.77
五、期末所有者权益（基金净值）	10,308,268,814.88	—	10,308,268,814.88
项目	上年度可比期间2015年7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）	200,021,402.26	—	200,021,402.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	25,994,190.07	25,994,190.07
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）	9,825,282,384.67	—	9,825,282,384.67
其中：1.基金申购款	9,825,286,587.66	—	9,825,286,587.66
2.基金赎回款	-4,202.99	—	-4,202.99
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）	—	25,994,190.07	-25,994,190.07
五、期末所有者权益（基金净值）	10,025,303,786.93	—	10,025,303,786.93

注：本基金合同于2015年7月23日生效，2015年度数据按实际存续期计算。

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：

卓新章

黄文锋

夏鹏

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

兴业添天盈货币市场基金(以下简称"本基金")系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业添天盈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]1289号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为200,021,402.26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(15)第1227号的验资报告。基金合同于2015年7月23日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额(以下简称"兴业添天盈货币

A")和B类基金份额(以下简称"兴业添天盈货币B")两类份额。其中,兴业添天盈货币A是指按照0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别;兴业添天盈货币B是指按照0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准采用:七天通知存款利率(税后)。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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相一致。

#### 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 差错更正的说明

本基金在本报告年度无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- 1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。
- 2)证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖

股票、债券免征营业税和增值税。

3) 对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。

4) 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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	基金托管人
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人的子公司
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期（及上年度可比期间）未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期（及上年度可比期间）未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年7月 23日至2015年12月31日
当期发生的基金应支 付的管理费	27,436,311.82	2,869,178.22
其中：支付销售机构 的客户维护费	—	—

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.27%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%÷当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间2015年7月 23日至2015年12月31日
当期发生的基金应支 付的托管费	5,080,798.44	531,329.26

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

#### 7.4.8.2.3 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 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B	合计
兴业基金管理有限公司	59.68	1,016,141.96	1,016,201.64

司			
合计	59.68	1,016,141.96	1,016,201.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年7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		
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B	合计
兴业基金管理有限公司	23.04	106,259.61	106,282.65
合计	23.04	106,259.61	106,282.65

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、B两类基金份额：A类基金按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，B类基金按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给兴业基金，再交由兴业基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A类基金日销售服务费=前一日A类基金份额对应的资产净值×0.25%÷当年天数；

B类基金日销售服务费=前一日B类基金份额对应的资产净值×0.01%÷当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 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12月31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 添天 盈货 币B	兴业银行	10,308,247,924. 81	100.00%	10,025,286,247. 03	100.00%

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资兴业添天盈货币A。

**7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间2015年7月23日 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	23,102,142.53	1,672,716.69	2,115.78	573,075.60

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生其他关联方交易事项。

**7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.9.1 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/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.9.2 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股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截止本报告期末2016年12月31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89,099,746.35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
120225	12国开25	2017-01-03	99.67	900000	89,703,000.00
合计				900,000.00	89,703,000.00

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末持有的债券中无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币8,470,039,250.24元，无属于第一层次和第三层次的余额(于2015年12月31日：第二层次为人民币1,715,358,103.50元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	8,470,039,250.24	81.43
	其中：债券	8,266,548,203.37	79.47
	资产支持证券	203,491,046.87	1.96
2	买入返售金融资产	605,424,788.15	5.82
	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	1,288,102,142.53	12.38
4	其他各项资产	38,523,035.64	0.37
5	合计	10,402,089,216.56	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	3.75	
	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	89,099,746.35	0.86
	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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的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	109



报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	57

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

### 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	17.84	0.86
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	16.11	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	21.31	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	4.51	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	40.76	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	100.54	0.86

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

### 8.5 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	1,039,584,060.10	10.08
	其中：政策性金融债	1,039,584,060.10	10.08
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	2,186,008,412.14	21.21
6	中期票据	—	—
7	同业存单	5,040,955,731.13	48.90
8	其他	—	—
9	合计	8,266,548,203.37	80.19
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

8.6 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	111608228	16中信CD228	6,000,000	597,713,744.45	5.80
2	111613109	16浙商CD109	5,000,000	487,524,453.22	4.73
3	011698725	16国电SCP006	3,500,000	345,114,595.24	3.35
4	011697031	16南电SCP002	3,500,000	344,456,697.59	3.34
5	011699663	16广州发展SCP001	3,000,000	299,664,161.67	2.91
6	111618180	16华夏CD180	3,000,000	297,711,875.16	2.89
7	111697206	16宁波银行CD192	3,000,000	297,216,314.48	2.88
8	1116083	16中信CD301	3,000,000	297,105,869.34	2.88

	01				
9	0116986 30	16东航股 SCP014	3,000,000	296,541,264.17	2.88
10	1116974 09	16宁波银行 CD198	3,000,000	296,224,407.46	2.87

### 8.7 “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	0.1674
报告期内偏离度的最低值	-0.1818
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0687

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无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

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

### 8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净 值 比例(%)
1	1689086	16永生1A1	1,200,000.00	102,000,000.00	0.99
2	1589208	15京诚1A2	1,400,000.00	34,818,000.00	0.34
3	1689038	16睿程1A2	670,000.00	15,343,000.00	0.15
4	1689043	16旭越1A1	440,000.00	12,936,000.00	0.13
5	1689123	16德宝天元 1A1	1,630,000.00	11,263,300.00	0.11
6	1589145	15湘元2A	1,900,000.00	10,241,000.00	0.10
7	123836	建租一A4	171,000.00	8,100,690.62	0.08
8	1589160	15平银1A2	490,000.00	6,139,700.00	0.06

9	123978	德润优A2	90,000.00	2,500,321.97	0.02
---	--------	-------	-----------	--------------	------

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明。

本基金计价采用摊余成本法，即计价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。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

### 8.9.2

报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

### 8.9.3 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	38,523,035.64
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	38,523,035.64

## § 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	持有 份额	占总份 额

				比例		比例
兴业添天盈货币A	259	80.66	—	—	20,890.07	100.00%
兴业添天盈货币B	1	10,308,247,924.81	10,308,247,924.81	100.00%	—	—
合计	260	39,647,187.75	10,308,247,924.81	100.00%	20,890.07	—

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	兴业添天盈货币A	9,279.34	44.42%
	兴业添天盈货币B	—	—
	合计	9,279.34	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	兴业添天盈货币A	0
	兴业添天盈货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业添天盈货币A	0
	兴业添天盈	0

	货币B	
	合计	0

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
基金合同生效日(2015年7月23日)基金份额总额	21,402.26	200,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	17,539.90	10,025,286,247.03
本报告期期间基金总申购份额	328,215.45	282,961,677.78
减：本报告期期间基金总赎回份额	324,865.28	—
本报告期期间基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	20,890.07	10,308,247,924.81

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

2016年12月，张顺国先生担任兴业基金管理有限公司副总经理职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。本报告期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

本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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为12万

元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为2年。

### 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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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		备注
		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	
兴业证券	2	—	—	165,271,894.88	100.00%	—	—	—	—	

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。
- vi 评估方法:由投资总监、研究总监根据以上因素评分。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期没有新增和剔除的券商交易单元。

### **11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况**

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

兴业基金管理有限公司  
二〇一七年三月三十一日