

# 兴全添利宝货币市场基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：兴全基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 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 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

### 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§5 托管人报告.....</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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 .....	13
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 .....	13
<b>§6 审计报告.....</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>14</b>
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 债券回购融资情况.....	40
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
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.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	42
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	42
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
8.9 投资组合报告附注.....	43
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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的情况.....	44
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4 基金投资策略的改变.....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	46
11.9 其他重大事件.....	46
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
13.1 备查文件目录.....	48
13.2 存放地点.....	48
13.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全添利宝货币市场基金
基金简称	兴全添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	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
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,078,464,877.07 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

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

### 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		兴全基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址）
邮政编码	200122	200041
法定代表人	庄园芳	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	兴全基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼

## § 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	2014 年 2 月 27 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,960,579,165.37	3,172,367,028.83	2,237,622,478.42
本期利润	1,956,079,165.37	3,172,367,028.83	2,237,622,478.42
本期净值收益率	2.8947%	4.0542%	4.3221%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末基金资产净值	43,078,464,877.07	67,543,171,677.68	55,141,438,481.19
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
累计净值收益率	11.6937%	8.5515%	4.3221%

注：1、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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

## 3.2 基金净值表现

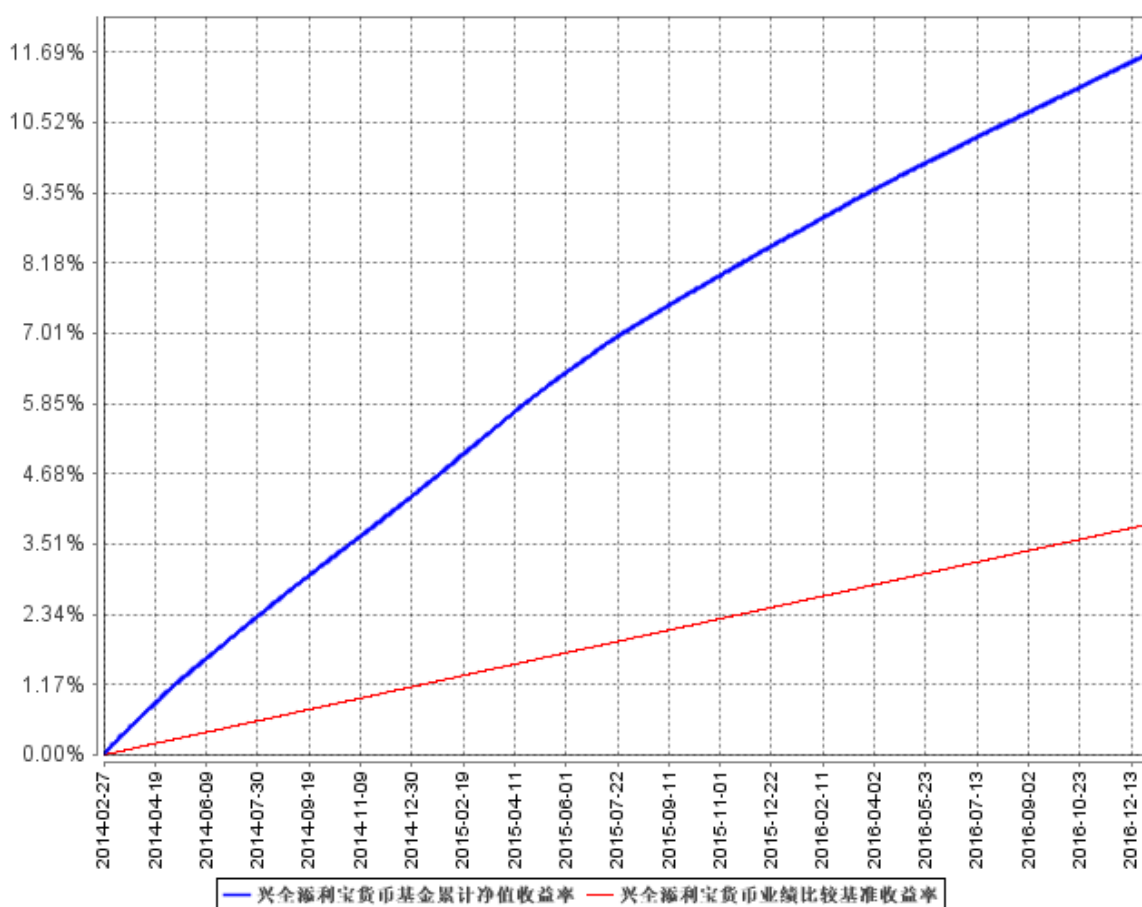
### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.6940%	0.0019%	0.3403%	0.0000%	0.3537%	0.0019%
过去六个月	1.3848%	0.0015%	0.6805%	0.0000%	0.7043%	0.0015%
过去一年	2.8947%	0.0014%	1.3537%	0.0000%	1.5410%	0.0014%
自基金合同生效起至今	11.6937%	0.0031%	3.8429%	0.0000%	7.8508%	0.0031%

注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴全基金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

### 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

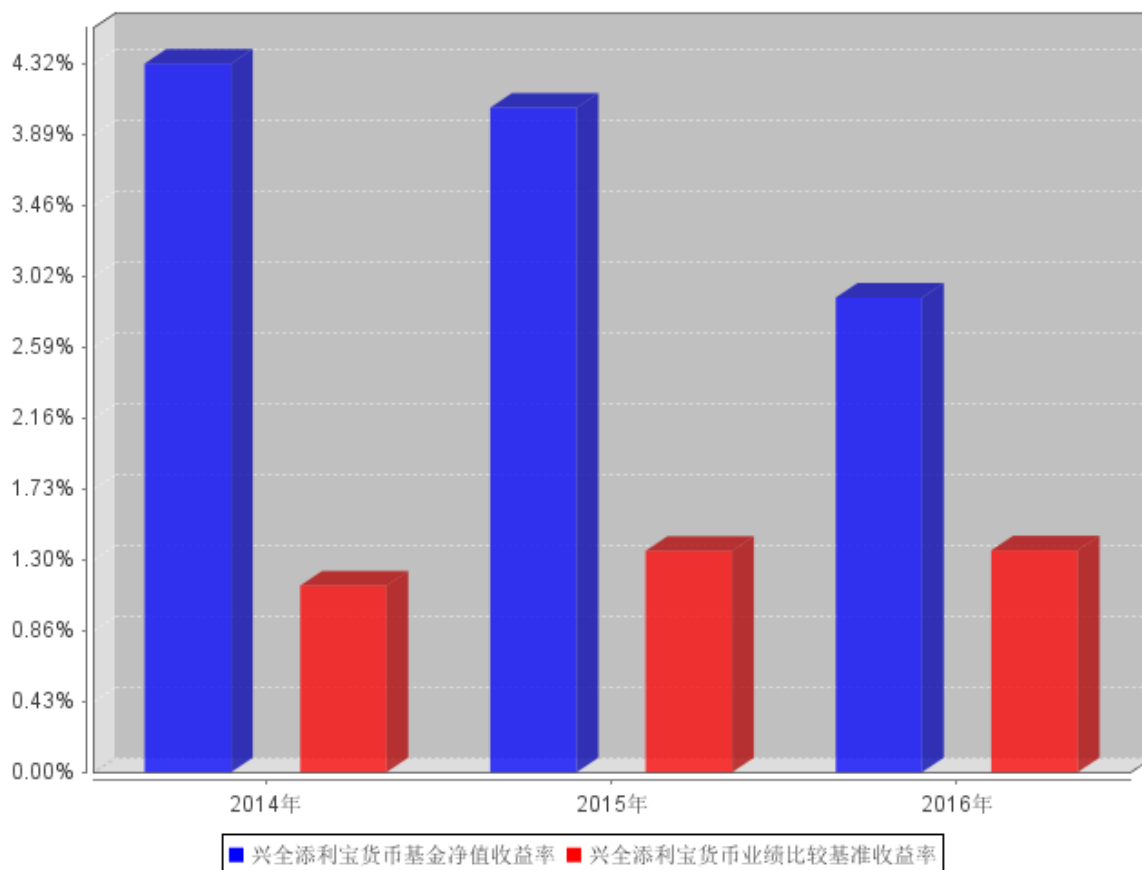


注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 12 月 31 日。

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。

### 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

兴全添利宝货币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对比图



注：2014 年数据统计期间为 2014 年 2 月 27 日（基金合同生效之日）至 2014 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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	1,956,079,165.37	-	-	1,956,079,165.37	
2015	3,172,367,028.83	-	-	3,172,367,028.83	
2014	2,237,622,478.42	-	-	2,237,622,478.42	

合计	7,366,068,672.62	-	-	7,366,068,672.62
----	------------------	---	---	------------------

## § 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

兴全基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。

截止2016年12月31日，公司旗下管理着十八只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰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（助理）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	2015年6月30日	-	11年	工商管理硕士，历任兴全基金管理有限公司基金会计、交易员、基金经理助理。



	全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、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理	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，兴全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 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

本基金管理人制定了《兴全基金管理有限公司公平交易制度》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年的全球金融市场经历了诸多黑天鹅，债券市场结束了三年的牛市，以一次剧烈调整收官。回顾全年，上半年和下半年的政策和市场均发生巨大的逆转：货币政策上，随着美联储加息的节奏逐渐明朗，市场对长期货币宽松的质疑声音逐渐增强，“全球零利率”转向“流动性拐点”，美债随之大幅调整；政治上，经历了长时间的“地球村”自由贸易和市场经济的繁荣后，英国脱欧、特朗普当选等预期之外的事件将在多大程度上重塑全球前景和格局，仍然是一个且行且看的未知数；实体领域，油气、金属等大宗商品价格超跌反弹，轮番上涨，“再通胀”预期再起。国内市场上，在地产的带动下，经济数据触底企稳，PPI 由负转正，环比涨幅迭创新高，基本面企稳迹象渐现。“三去一补一降”的政策基调贯穿全年，去产能、去库存的意料之外的商品、房价急速上涨，去杠杆基调下，央行主动收紧了流动性阀门，导致了流动性骤紧，金融体系内连续几年的自我膨胀结束，杠杆链条调整主导了债市下半场；降成本、补短板政策则需要更加长期和深远的制度改革。

纵观 2016 年，债券市场经历了宽幅震荡过山车型走势，上半年在经济下行的压力下，央行不断出台宽松的货币政策，促使债券市场走牛，上半年 4 月在信用违约的冲击下大幅回调。之后，随着事件冲击消散，经济刺激因素走弱，L 型走势确立，债券重拾牛市，涨到 10 年高点。宽松的资金供给和较弱的投资需求使得流动性淤积在金融系统内部，使得金融体系在低成本资金的推动下大幅自我膨胀，“资产荒”泛滥，叠加人民币贬值，房价迅速上涨、商品也出现投机热，大量资金脱实向虚。为了防控金融系统风险和资产泡沫，央行主动收紧流动性，债市走向逆转。基于对市场的深度分析，本基金整体上采取防守反击策略，果断抓住了上半年的调整机会，逆势加仓，在牛市顶点则着重控制规模，保持投资的灵活性，主动降低杠杆和久期，从而在所谓“债灾”期间安然度过，并择机配置高收益资产，实现了远超基准的收益。

### 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 2.8947%，同期业绩比较基准收益率 1.3537%。

#### 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，特朗普政府新政、联储的加息节奏、欧洲的政治走向等不确定性仍将牵扯着全球金融市场的神经。全球再通胀的基础上，预计各国央行在货币政策的选择上也将更加谨慎。反观国内，人民币是否能够在目前的水平上企稳，库存周期的持续时间，政府对经济下滑的容忍度，金融体系“去杠杆”将左右未来一年的政策基调。经济层面，我们判断大概率以稳为主：一是全球层面上来看，经济有止跌企稳的态势；二，随着国内地产库存的逐渐去化，预计地产投资可以保持平稳略有增长的态势；三是随着对环保的重视和强力推行供给侧改革的措施到位，中观行业层面的产业集中度不断提升，企业利润大概率持续改善，从而带来新增投资的需求；最后，随着人口代际的更迭持续，国内的消费升级也逐渐成为主流，未来内需消费或许并不弱。政策层面，金融大监管时代正式开启，从严监管趋势明朗，作为体量最大的银行理财的监管新规或将重塑金融市场格局。在 16 年的洗礼之后，固定收益产品在运作上将更加成熟，关注流动性风险和绝对收益，预计资金价格中枢明显抬升且维持高位，货币基金也将获得不错的收益，为投资者带来满意的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐

条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经验，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本基金自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按日结转到份额持有人的基金账户。本报告期内，本基金本报告期内向基金份额持有人分配利润 1,956,079,165.37 元，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 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

无。

## § 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

本托管人依据《兴全添利宝货币市场基金基金合同》与《兴全添利宝货币市场基金托管协议》，自 2014 年 2 月 27 日起托管兴全添利宝货币市场基金（以下称“本基金”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基

金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

## 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# § 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	德师报(审)字(17)第 P00876 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	兴全添利宝货币市场基金全体持有人：
引言段	我们审计了后附的兴全添利宝货币市场基金(以下简称“兴全添利宝”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、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兴全添利宝基金管理人兴全基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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	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。 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管理层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。 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。
审计意见段	我们认为，兴全添利宝的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全添利宝 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。
注册会计师的姓名	许湘照 汪芳
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 上海
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	23,805,463,703.15	35,058,445,196.03
结算备付金		19,889,588.47	17,588,095.24
存出保证金		14,967.27	-
交易性金融资产	7.4.7.2	18,337,224,169.42	28,513,624,404.41
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,337,224,169.42	28,411,624,404.41
资产支持证券投资		-	102,000,000.00
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	3,010,312,065.46	7,276,003,833.99
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	227,101,579.27	540,724,267.34
应收股利		-	-

应收申购款		98,593,807.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		45,498,599,880.54	71,406,385,797.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		2,385,203,797.33	2,227,997,285.00
应付证券清算款		9,908,000.05	1,600,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,253,391.32	16,236,923.13
应付托管费		2,083,961.34	3,006,837.63
应付销售服务费		10,419,806.77	15,034,188.11
应付交易费用	7.4.7.7	441,216.79	361,670.22
应交税费		-	-
应付利息		599,829.87	282,215.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	225,000.00	295,000.00
负债合计		2,420,135,003.47	3,863,214,119.33
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	43,078,464,877.07	67,543,171,677.68
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		43,078,464,877.07	67,543,171,677.68
负债和所有者权益总计		45,498,599,880.54	71,406,385,797.01

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 43,078,464,877.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

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	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		2,461,817,246.11	3,713,824,118.38
1.利息收入		2,506,608,893.71	3,525,208,155.21

其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,440,737,877.63	2,500,440,888.15
债券利息收入		959,141,910.86	861,143,830.33
资产支持证券利息收入		387,787.82	1,484,606.69
买入返售金融资产收入		106,341,317.40	162,138,830.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-40,291,647.60	188,510,777.17
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	-40,291,647.60	188,510,777.17
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,500,000.00	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	105,186.00
<b>减：二、费用</b>		505,738,080.74	541,457,089.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	185,261,077.81	220,027,570.21
2. 托管费	7.4.10.2.2	34,307,606.94	40,745,846.40
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	171,538,034.97	203,729,231.78
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		114,116,795.39	76,383,112.92
其中：卖出回购金融资产支出		114,116,795.39	76,383,112.92
6. 其他费用	7.4.7.20	514,565.63	571,328.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,956,079,165.37	3,172,367,028.83
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,956,079,165.37	3,172,367,028.83

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

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	67,543,171,677.68	-	67,543,171,677.68



金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,956,079,165.37	1,956,079,165.37
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)	-24,464,706,800.61	-	-24,464,706,800.61
其中:1.基金申购款	302,221,870,898.96	-	302,221,870,898.96
2.基金赎回款	-326,686,577,699.57	-	-326,686,577,699.57
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)	-	-1,956,079,165.37	-1,956,079,165.37
五、期末所有者权益(基金净值)	43,078,464,877.07	-	43,078,464,877.07
项目	上年度可比期间 2015年1月1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)	55,141,438,481.19	-	55,141,438,481.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,172,367,028.83	3,172,367,028.83
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)	12,401,733,196.49	-	12,401,733,196.49
其中:1.基金申购款	573,531,156,008.22	-	573,531,156,008.22
2.基金赎回款	-561,129,422,811.73	-	-561,129,422,811.73
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)	-	-3,172,367,028.83	-3,172,367,028.83
五、期末所有者权益(基金净值)	67,543,171,677.68	-	67,543,171,677.68

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:

\_\_\_\_\_  
庄园芳  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
庄园芳  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
詹鸿飞  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全添利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全添利宝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[2014]217 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 1,306,102,190.00 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(14)第 0174 号验资报告。《兴全添利宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 2 月 27 日正式生效。本基金的管理人为兴全基金管理有限公司,托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资范围为以下金融工具: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、大额存单、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)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、中国证监会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同期七天通知存款利率(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 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 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。

#### 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

本基金的金融资产分类为交易性金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，在初始确认时以公允价值计量。

### 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

#### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含付息债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (2) 回购协议

基金持有的回购协议，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。相关金融资产或负债在回购日按账面余额结转。

本基金对所持有的债券投资和其他金融负债均以摊余成本法进行后续计量。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当收取金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法估算公允价值。估值对象以买入成本列示，买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，按实际利率每日计提收益或损失。

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 0.5%的情形，基金管理人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。

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。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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 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 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。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通[2006]22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(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 0.27%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，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，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，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；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基

金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自申购确认之日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自赎回确认之日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、国税函[2008]870 号《关于做好证券市场个人投资者证券交易结算资金利息所得免征个人所得税工作的通知》、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) 对证券投资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 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	7,033,461,703.15	2,541,095,196.03
定期存款	16,772,002,000.00	32,517,350,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	7,870,000,000.00	1,050,000,000.00
存款期限 1 个月内	3,150,000,000.00	2,200,000,000.00
存款期限 3 个月以上	5,752,002,000.00	29,267,350,000.00
其他存款	-	-
合计：	23,805,463,703.15	35,058,445,196.03

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 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	108,175,647.57	107,270,441.02	-905,206.55	-0.0021%
	银行间市场	18,229,048,521.85	18,221,526,000.00	-7,522,521.85	-0.0175%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	18,337,224,169.42	18,328,796,441.02	-8,427,728.40	-0.0196%
项目		上年度末 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	28,411,624,404.41	28,496,892,000.00	85,267,595.59	0.1262%
	资产支持证券	102,000,000.00	102,156,000.00	-	0.0002%

	合计	28,513,624,404.41	28,599,048,000.00	85,423,595.59	0.1265%
--	----	-------------------	-------------------	---------------	---------

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	60,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	2,950,312,065.46	-
合计	3,010,312,065.46	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	5,676,003,833.99	-
买入返售证券_交易所	1,600,000,000.00	-
合计	7,276,003,833.99	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	7,954,258.90	4,424,134.69
应收定期存款利息	45,958,700.67	92,865,189.00
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	9,845.33	8,706.06
应收债券利息	165,311,412.52	427,876,775.84



应收买入返售证券利息	7,867,354.48	15,549,461.75
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	7.37	-
合计	227,101,579.27	540,724,267.34

注：应收债券利息包含资产支持证券利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 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	441,216.79	361,670.22
合计	441,216.79	361,670.22

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	225,000.00	295,000.00
-	-	-
合计	225,000.00	295,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,543,171,677.68	67,543,171,677.68
本期申购	302,221,870,898.96	302,221,870,898.96
本期赎回(以“-”号填列)	-326,686,577,699.57	-326,686,577,699.57
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	43,078,464,877.07	43,078,464,877.07

注：申购含红利再投资。

#### 7.4.7.10 未分配利润

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
上年度末	-	-	-
本期利润	1,960,579,165.37	-4,500,000.00	1,956,079,165.37
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	-1,960,579,165.37	4,500,000.00	-1,956,079,165.37
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	219,333,599.14	146,729,592.05
定期存款利息收入	1,220,625,490.71	2,353,392,280.79
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	778,697.83	319,015.31
其他	89.95	-
合计	1,440,737,877.63	2,500,440,888.15

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1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	-40,291,647.60	188,510,777.17

付) 差价收入		
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	-40,291,647.60	188,510,777.17

#### 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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1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	135,040,223,019.20	60,573,205,732.74
减: 卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	133,882,750,734.35	58,627,433,387.24
减: 应收利息总额	1,197,763,932.45	1,757,261,568.33
买卖债券差价收入	-40,291,647.60	188,510,777.17

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

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1月1日至2015年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	102,738,413.11	-
减: 卖出资产支持证券成本总额	102,000,000.00	-
减: 应收利息总额	738,413.11	-
资产支持证券投资收益	-	-

本基金上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,500,000.00	-
——股票投资	-	-
——债券投资	-4,500,000.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-4,500,000.00	-

**7.4.7.18 其他收入**

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1月1日至2015年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	105,186.00
合计	-	105,186.00

**7.4.7.19 交易费用**

本基金本报告期末及上年度末均未发生交易费用。

**7.4.7.20 其他费用**

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1月1日至2015年 12月31日
审计费用	96,000.00	96,000.00
信息披露费	190,000.00	190,000.00
其他	2,671.80	5,212.23
银行汇划费	189,893.83	244,116.01

账户服务费	36,000.00	36,000.00
合计	514,565.63	571,328.24

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要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
兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：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

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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1月1日至2015年12月31日	
	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 成交总额的比例
兴业证券	174,985,310.09	100.00%	-	-

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：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1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	115,442,634,000.00	100.00%	33,135,928,000.00	100.00%

**7.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

**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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	185,261,077.81	220,027,570.21
其中：支付销售机构的客户维护费	44,786.64	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.27%/当年天数。

**7.4.10.2.2 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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	34,307,606.94	40,745,846.40

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.05%/当年天数。

## 7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 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	
兴全基金管理有限公司	171,538,034.97	
合计	171,538,034.97	
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
兴全基金管理有限公司	203,729,231.78	
合计	203,729,231.78	

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人代付给各基金销售机构。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金销售服务费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

## 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

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	545,560,617.00	-	-	-	4,162,020,000.00	339,432.39
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	4,036,299,440.90	134,625,215.76	-	-	2,287,210,000.00	159,490.41

## 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

份额单位：份

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1月1日至2015年12月31日

期初持有的基金份额	539,520,095.18	303,300,793.87
期间申购/买入总份额	1,464,506,344.59	1,404,219,301.31
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,303,000,000.00	1,168,000,000.00
期末持有的基金份额	701,026,439.77	539,520,095.18
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.6273%	0.7988%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 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

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
兴业证券	3,750,960,791.09	8.7073%	719,307,320.80	1.0650%
兴全睿众	23,427,501.48	0.0544%	44,079,012.99	0.0653%
兴业银行	4,209,876,897.50	9.7726%	5,114,670,862.69	7.5724%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 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 2016年1月1日至2016年12月31 日		上年度可比期间 2015年1月1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
兴业银行	8,133,461,703.15	524,034,431.55	10,741,095,196.03	614,492,125.67

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：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



1,956,079,165.37	-	-	1,956,079,165.37	-
------------------	---	---	------------------	---

#### 7.4.12 ( 2016 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

本基金本年末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限证券。

##### 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

截至本报告期末 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 2,295,103,797.33 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
111691753	16 南充商行 CD007	2017 年 1 月 3 日	99.30	1,040,000	103,267,159.86
111696956	16 南充商行 CD036	2017 年 1 月 6 日	99.44	3,000,000	298,326,255.31
070208	07 国开 08	2017 年 1 月 3 日	99.64	1,540,000	153,442,663.15
120227	12 国开 27	2017 年 1 月 3 日	98.85	900,000	88,964,527.92
160202	16 国开 02	2017 年 1 月 3 日	99.67	100,000	9,966,801.75
041662032	16 威高 CP001	2017 年 1 月 3 日	100.13	400,000	40,052,156.39
111695711	16 温州银行 CD099	2017 年 1 月 3 日	97.84	2,370,000	231,891,525.33
011698268	16 云能投 SCP005	2017 年 1 月 3 日	99.97	1,000,000	99,971,636.95
041653021	16 河南有线 CP001	2017 年 1 月 3 日	100.08	200,000	20,016,978.03
011698118	16 云能投 SCP004	2017 年 1 月 4 日	99.98	600,000	59,986,371.91
111680128	16 广东南粤银行 CD107	2017 年 1 月 5 日	99.58	1,660,000	165,308,576.67
111680033	16 厦门银行 CD136	2017 年 1 月 6 日	99.61	350,000	34,863,284.83

041655025	16 中天科 集 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.65	300,000	29,895,043.59
111691032	16 泉州银 行 CD015	2017 年 1 月 3 日	99.47	2,500,000	248,678,864.25
111691246	16 吉林银 行 CD031	2017 年 1 月 3 日	99.34	1,360,000	135,105,083.40
111696905	16 吉林银 行 CD135	2017 年 1 月 3 日	99.47	1,600,000	159,153,341.96
041654069	16 大秦铁 路 CP002	2017 年 1 月 6 日	98.90	2,200,000	217,569,728.42
011698118	16 云能投 SCP004	2017 年 1 月 5 日	99.98	400,000	39,990,914.60
011699909	16 闽能源 SCP007	2017 年 1 月 3 日	99.96	500,000	49,978,598.67
041653041	16 云能投 CP002	2017 年 1 月 3 日	100.30	300,000	30,088,629.64
011698076	16 广晟 SCP005	2017 年 1 月 3 日	100.07	700,000	70,049,523.73
041671005	16 南新工 CP001	2017 年 1 月 3 日	99.58	400,000	39,831,208.71
120223	12 国开 23	2017 年 1 月 3 日	99.76	840,000	83,797,921.61
合计				24,260,000	2,410,196,796.68

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 90,100,000.00 元,于 2017 年 1 月 6 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务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以识别及分析相关风险,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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金主要投资于银行定期存款、国债、央行票据和具有良好信用等级的其他债券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款主要存放于本基金的托管人兴业银行和其他信用良好的境内商业银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，主要在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金、提前支取定期存款等方式应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016	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
-------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	10,183,461,703.15	7,870,000,000.00	5,752,002,000.00	-	-	-	23,805,463,703.15
结算备付金	19,889,588.47	-	-	-	-	-	19,889,588.47
存出保证金	14,967.27	-	-	-	-	-	14,967.27
交易性金融资产	1,579,512,553.37	6,219,741,060.29	10,512,470,555.76	-	-	25,500,000.00	18,337,224,169.42
买入返售金融资产	2,667,447,031.16	342,865,034.30	-	-	-	-	3,010,312,065.46
应收利息	-	-	-	-	-	227,101,579.27	227,101,579.27
应收申购款	98,593,807.50	-	-	-	-	-	98,593,807.50
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	14,548,919,650.92	14,432,606,094.59	16,264,472,555.76	-	-	252,601,579.27	45,498,599,880.54
负债							
卖出回购金融资产款	2,385,203,797.33	-	-	-	-	-	2,385,203,797.33
应付证券清算款	-	-	-	-	-	9,908,000.05	9,908,000.05
应付管理人报	-	-	-	-	-	11,253,391.32	11,253,391.32

酬							
应付 托管 费	-	-	-	-	-	2,083,961.34	2,083,961.34
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	10,419,806.77	10,419,806.77
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	441,216.79	441,216.79
应付 利息	-	-	-	-	-	599,829.87	599,829.87
其他 负债	-	-	-	-	-	225,000.00	225,000.00
负债 总计	2,385,203,797.33	-	-	-	-	34,931,206.14	2,420,135,003.47
利率 敏感 度缺 口	12,163,715,853.59	14,432,606,094.59	16,264,472,555.76	-	-	217,670,373.13	43,078,464,877.07
上年 度末 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	10,783,445,196.03	11,005,000,000.00	13,270,000,000.00	-	-	-	35,058,445,196.03
结算 备付 金	17,588,095.24	-	-	-	-	-	17,588,095.24
交易 性金 融资 产	2,254,172,851.84	15,572,641,913.85	10,686,809,638.72	-	-	-	28,513,624,404.41
买入 返售 金融 资产	4,442,308,063.45	2,784,695,577.04	49,000,193.50	-	-	-	7,276,003,833.99
应收	-	-	-	-	-	540,724,267.34	540,724,267.34

利息							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	17,497,514,206.56	29,362,337,490.89	24,005,809,832.22	-	-	540,724,267.34	71,406,385,797.01
负债							
卖出回购金融资产款	2,227,997,285.00	-	-	-	-	-	2,227,997,285.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,600,000,000.00	1,600,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	16,236,923.13	16,236,923.13
应付托管费	-	-	-	-	-	3,006,837.63	3,006,837.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,034,188.11	15,034,188.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	361,670.22	361,670.22
应付利息	-	-	-	-	-	282,215.24	282,215.24
其他负债	-	-	-	-	-	295,000.00	295,000.00
负债总计	2,227,997,285.00	-	-	-	-	1,635,216,834.33	3,863,214,119.33
利率敏感度缺口	15,269,516,921.56	29,362,337,490.89	24,005,809,832.22	-	-	-1,094,492,566.99	67,543,171,677.68

注：1、表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金合同于 2014 年 2 月 27 日生效。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	利率+1%	-71,218,922.81	-79,276,189.93
	利率-1%	71,912,645.56	79,842,592.56

注:1. 上表反映了在其他变量不变的假设下,利率发生合理、可能的变动时,为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险,市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,且以摊余成本进行后续计量,因此无重大市场价格风险。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 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银行存款、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款及其他金融负债,其账面价值与公允价值接近。

##### (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且其变动计入当期损益的金融工具中属于第二层次的余额为18,337,224,169.42元,无属于第一层次和第三层次的余额(2015年12月31日:

第二层次的余额为 28,513,624,404.41 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

对于证券交易所上市的债券，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，确定相关股票和债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。

## § 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	18,337,224,169.42	40.30
	其中：债券	18,337,224,169.42	40.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,010,312,065.46	6.62
	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	23,825,353,291.62	52.37
4	其他各项资产	325,710,354.04	0.72
5	合计	45,498,599,880.54	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	7.28	
	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	2,385,203,797.33	5.54
	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的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

### 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	93
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	53

#### 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。

#### 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	31.98	5.35
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.53	-
2	30 天(含)—60 天	11.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	23.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.67	-
4	90 天(含)—120 天	5.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	33.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.86	5.35

#### 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

本报告期内投资组合平均剩余存续期没有发生超过 240 天的情况。

#### 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	2,117,858,729.06	4.92
	其中：政策性金融债	2,117,858,729.06	4.92
4	企业债券	108,175,647.57	0.25
5	企业短期融资券	6,954,835,351.67	16.14
6	中期票据	1,518,926,274.05	3.53
7	同业存单	7,637,428,167.07	17.73
8	其他	-	-
9	合计	18,337,224,169.42	42.57
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	517,979,244.74	1.20

### 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	111609501	16 浦发 CD501	8,000,000	781,909,459.13	1.82
2	111691092	16 泉州银行 CD016	5,000,000	497,260,795.57	1.15
3	111696915	16 江苏江南农村商业银 行 CD114	4,000,000	397,876,588.05	0.92
4	111695632	16 宁波银行 CD163	3,500,000	346,083,556.31	0.80
5	070206	07 国开 06	3,100,000	309,059,790.39	0.72
6	140322	14 进出 22	3,000,000	301,713,597.73	0.70
7	011699782	16 中材股 SCP001	3,000,000	300,693,338.66	0.70
8	011620002	16 中铝 SCP002	3,000,000	299,982,162.81	0.70
9	011620003	16 中铝 SCP003	3,000,000	299,604,186.12	0.70
10	070208	07 国开 08	3,000,000	298,914,278.87	0.69

### 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	0.1386%
报告期内偏离度的最低值	-0.1458%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0939%
------------------------	---------

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内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

本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%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所有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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1

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。

### 8.9.2

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。

### 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	14,967.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	227,101,579.27
4	应收申购款	98,593,807.50
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	325,710,354.04

### 8.9.4 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。

## § 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

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
1, 115, 798	38, 607. 76	20, 816, 224, 279. 76	48. 32%	22, 262, 240, 597. 31	51. 68%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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基金	50, 819, 923. 63	0. 1180%

### 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年2月27日)基金份额总额	1, 306, 102, 190. 00
本报告期期初基金份额总额	67, 543, 171, 677. 68
本报告期基金总申购份额	302, 221, 870, 898. 96
减:本报告期基金总赎回份额	326, 686, 577, 699. 57
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	43, 078, 464, 877. 07

注：总申购份额含红利再投资份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

(1) 报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

2016 年 1 月 13 日起, 郑文惠女士担任基金管理人副总经理。

2016 年 5 月 9 日起, 基金管理人的法定代表人、董事长由兰荣变更为庄园芳。

(2) 报告期内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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起连续 3 年聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 9.6 万元人民币。

### 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

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

注: 根据中国证监会的有关规定, 我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能

力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	174,985,310.09	100.00%	115,442,634,000.00	100.00%	-	-

本报告期内本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

### 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	旗下各基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台一亿元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
4	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
5	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
6	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 13 日
7	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台五百万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 13 日
8	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 15 日
9	兴全添利宝货币市场基金开通直销柜台转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 2 月 27 日
10	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台一千万元以	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 3 月 7 日

	上申购申请的公告		
11	关于兴全添利宝货币市场基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 17 日
12	关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 5 日
13	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
14	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台两千万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 13 日
15	关于调整开放式基金开户证件类型公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 21 日
16	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台四千万元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 21 日
17	旗下各基金 2016 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
18	关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
19	关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 2 日
20	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台一亿元以上申购申请的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 20 日
21	关于办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 21 日
22	关于山东山水水泥中期票据估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 22 日
23	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xqfunds.com>) 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。

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴全基金管理有限公司  
2017年3月31日