

# 兴全添利宝货币市场基金 2014 年第 3 季度 报告

2014 年 9 月 30 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2014 年 10 月 25 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 2014 年 10 月 24 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 2014 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	兴全添利宝货币
基金主代码	000575
交易代码	000575
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	77,118,796,144.89 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（2014年7月1日—2014年9月30日）
1. 本期已实现收益	833,361,139.17
2. 本期利润	833,361,139.17
3. 期末基金资产净值	77,118,796,144.89

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

#### 3.2 基金净值表现

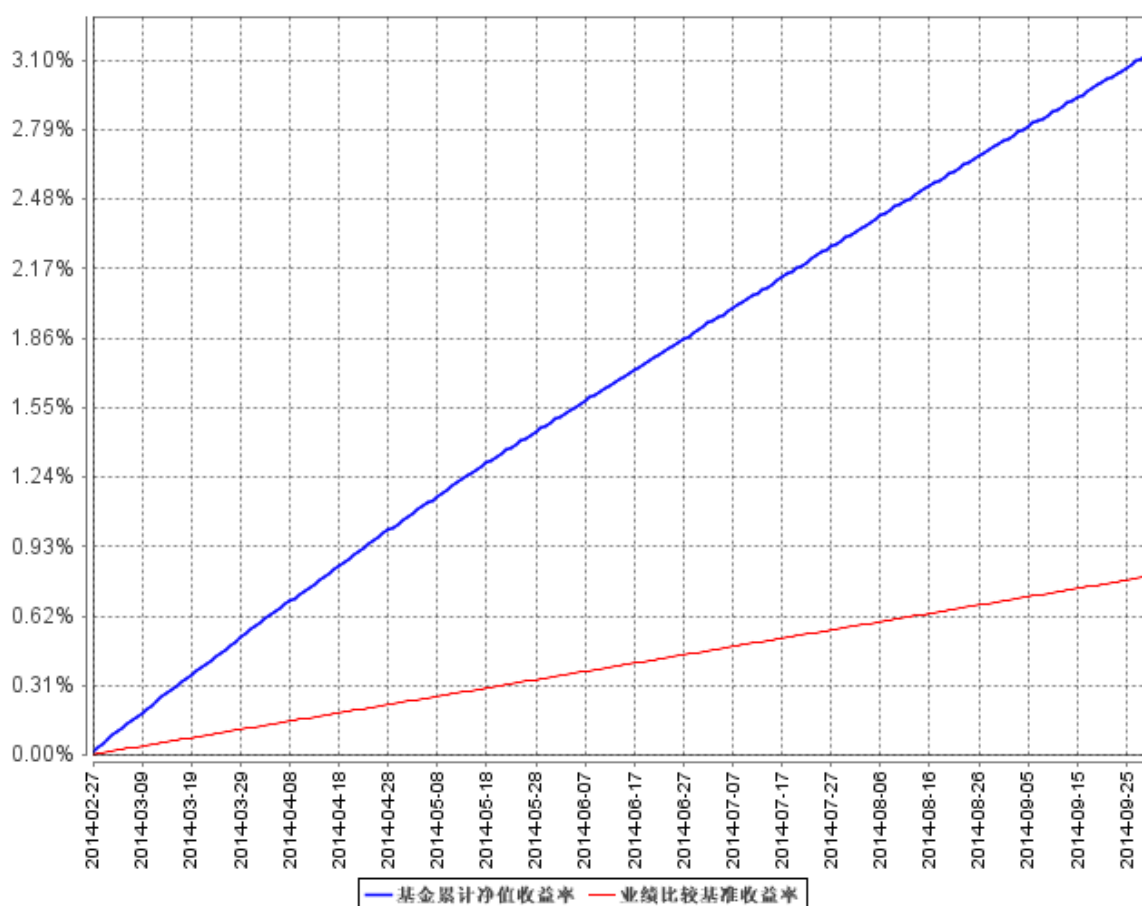
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2173%	0.0017%	0.3403%	0.0000%	0.8770%	0.0017%

注：本基金收益分配按日结转份额。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2014 年 9 月 30 日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2014 年 2 月 27 日至 2014 年 5 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2014 年 2 月 27 日，截止 2014 年 9 月 30 日，本基金成立不满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张睿	本基金基金经理	2014年2月27日	-	9年	1981年生，经济学硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴业全球基

					金管理有限公司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理。
毛水荣	本基金、兴全保本混合型证券投资基金和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理	2014年6月10日	-	11年	1979年生，经济学硕士。历任上海博弘投资管理有限公司投研部债券研究员；平安资产管理有限公司投资经理助理；华商基金管理有限公司基金经理助理、基金经理；2013年加入兴业全球基金管理有限公司。

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

种种数据表明，三季度经济增速将较二季度下行。在此环境下，货币政策也出现了转换：货币总量稳定的前提下，央行通过价格型工具引导短端利率下行；同时调整信贷结构，引导资金投向低风险领域。报告期内央行下调公开市场正回购利率，资金价格中枢稳步下移，R007 从季初 3.8% 的下移到季末的 3.2%，而在 9 月份推出大额 SLF 后，季末资金面已经变的非常宽松，IPO 对资金面的影响也逐步减小，债市做多情绪再次变得坚定。在货币持续宽松，经济抵抗性衰退的大氛围下，三季度的债市延续了上半年的多头行情。各期限品种收益率继续下降，信用利差压缩到历史均值的低位。运作期内，本组合在风险可控的大前提下，维持组合的较高久期，精选短融和同业存款，在短端收益率趋势下行中，力求了较高的整体收益。

##### 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为 1.2173%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，在经济放缓、外占低增的情况下，定向宽松已经成为常规工具，央行量价结合的“定向”宽松政策将延续；三季度通胀低于预期，在产出缺口为负、货币增速放缓以及美元走强之下，四季度核心依然是需求萎缩下的价格回落，宽松的货币环境下预计资金价格将维持常态低水平。在此背景下，本组合将继续优化现券的配置，灵活地进行波段操作，在保持基金较好流动性的基础上，力争较高的静态收益。

## § 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	23,760,038,671.45	28.30
	其中：债券	23,760,038,671.45	28.30
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,035,368,668.70	3.62
	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	55,904,052,122.12	66.60

4	其他资产	1,245,789,679.79	1.48
5	合计	83,945,249,142.06	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	7.87	
	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	6,778,044,657.62	8.79
	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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	101

### 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	38.28	8.79
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	17.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	5.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	14.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	180 天(含)-397 天(含)	31.41	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.69	8.79

#### 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	1,885,344,483.16	2.44
	其中: 政策性金融债	1,885,344,483.16	2.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,778,356,615.93	25.65
6	中期票据	2,096,337,572.36	2.72
7	其他	-	-
8	合计	23,760,038,671.45	30.81
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 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	140204	14 国开 04	6,050,000	606,298,099.62	0.79
2	041451037	14 酒钢 CP001	5,500,000	551,514,000.55	0.72
3	041452001	14 中铝业 CP001	4,800,000	485,309,733.37	0.63
4	011420005	14 中铝 SCP005	3,000,000	301,220,473.06	0.39
5	011420004	14 中铝 SCP004	3,000,000	301,157,122.72	0.39
6	011499028	14 豫能源 SCP001	3,000,000	299,989,531.13	0.39
7	011424004	14 中冶 SCP004	3,000,000	299,479,094.97	0.39
8	011481003	14 淮南矿 SCP003	2,900,000	290,338,736.22	0.38
9	011415005	14 中铝业	2,800,000	280,921,632.34	0.36



		SCP005			
10	041464005	14 郑煤 CP001	2,600,000	262,477,621.13	0.34

## 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	0.0662%
报告期内偏离度的最低值	0.0077%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0389%

## 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

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照实际利率每日计提应收利息，2007 年 7 月 1 日前按直线法，2007 年 7 月 1 日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

### 5.8.2

本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况。

**5.8.3** 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查。

### 5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	352,803,032.20
3	应收利息	892,986,647.59
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,245,789,679.79

### 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	51,933,762,857.15
报告期期间基金总申购份额	179,440,580,688.07
减：报告期期间基金总赎回份额	154,255,547,400.33
报告期期末基金份额总额	77,118,796,144.89

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	赎回	2014年7月8日	-11,000,000.00	-11,000,000.00	0.00%
2	赎回	2014年7月14日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	0.00%
3	赎回	2014年7月15日	-5,000,000.00	-5,000,000.00	0.00%
4	申购	2014年7月22日	20,000,000.00	20,000,000.00	0.00%
5	赎回	2014年7月28日	-6,000,000.00	-6,000,000.00	0.00%
6	红利再投	2014年7月31日	325,592.24	325,592.24	0.00%
7	申购	2014年8月6日	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
8	申购	2014年8月8日	25,000,000.00	25,000,000.00	0.00%
9	赎回	2014年8月13日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	0.00%
10	申购	2014年8月21日	24,000,000.00	24,000,000.00	0.00%
11	赎回	2014年8月26日	-57,000,000.00	-57,000,000.00	0.00%
12	红利再投	2014年8月31日	442,845.08	442,845.08	0.00%
13	申购	2014年9月3日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%

14	赎回	2014 年 9 月 15 日	-6,000,000.00	-6,000,000.00	0.00%
15	赎回	2014 年 9 月 17 日	-13,000,000.00	-13,000,000.00	0.00%
16	申购	2014 年 9 月 30 日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
17	红利再投	2014 年 9 月 30 日	521,398.63	521,398.63	0.00%
<b>合计</b>			62,289,835.95	62,289,835.95	

注：因本基金收益分配按日结转份额，上表中“红利再投”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。

兴全全球基金管理有限公司  
2014 年 10 月 25 日