兴全添利宝货币市场基金

2015 年度 报告摘要

2015年12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

送出日期：2016年3月25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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月24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01月01日起至12月31日止。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全添利宝货币
基金主代码	000575
场内简称	-
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
报告期末基金份额总额	67,543,171,677.68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		兴业全球基金管理有限公司	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@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099，021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

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	http://www.xyfunds.com.cn
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

§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	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	3,172,367,028.83	2,237,622,478.42
本期利润	3,172,367,028.83	2,237,622,478.42
本期净值收益率	4.0542%	4.3221%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-	-
期末基金资产净值	67,543,171,677.68	55,141,438,481.19
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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，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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

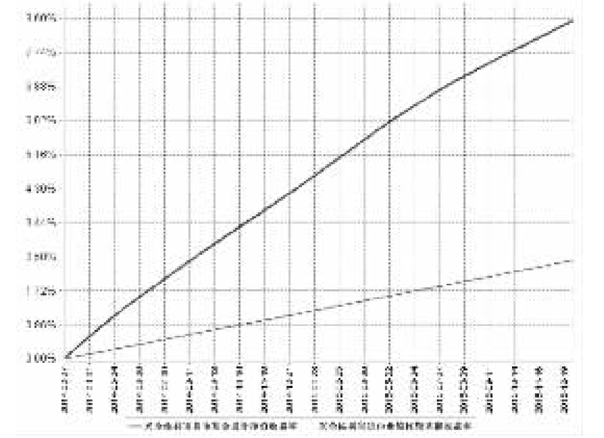
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去六个月	1.7203%	0.0015%	0.6805%	0.0000%	1.0398%	0.0015%
过去一年	4.0542%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	2.7042%	0.0024%
自基金合同生效起至今	8.5515%	0.0026%	2.4892%	0.0000%	6.0623%	0.0026%

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业全球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

兴全添利宝货币市场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

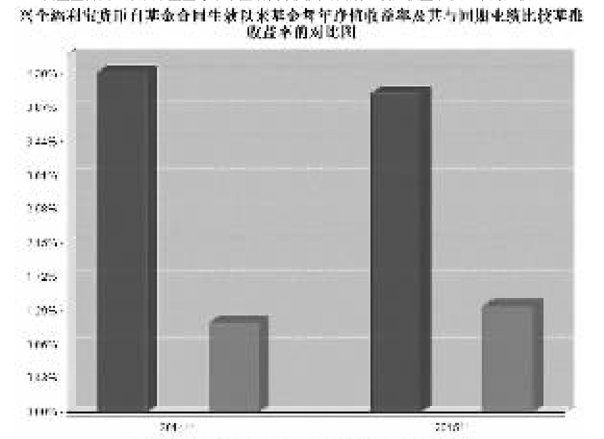


注：1、净值表现所取数据截至到2015年12月31日。

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

兴全添利宝货币市场基金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 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
2015	3,172,367,028.83	-	-	3,172,367,028.83	
2014	2,237,622,478.42	-	-	2,237,622,478.42	
合计	5,409,989,507.25	-	-	5,409,989,507.25	

§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

兴业全球基金管理有限公司是经中国证监会（证监基字[2003]100号文）批准，于2003年9月30日成立。2008年1月2日，中国证监会批准（证监许可 [2008]6号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，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%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”。2008年7月7日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币1.2亿元变更为人民币1.5亿元。

截止2015年12月31日，公司旗下管理着十七只基金，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。

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		
张睿	本基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理	2014年2月27日	-	10年	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、兴全磐稳增利债券型证券投资基金。
钟明	本基金、兴全货币市场基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理	2015年6月30日	-	10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。

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遵规守信情况的说明

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。管理人于2015年8月3日收到上海证监局发出的《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求对人员行为和异常交易加强日常管理。管理人已积极整改。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《兴业全球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

2015年全球经济体分化严重，美元指数的大幅上升使得人民币内在贬值压力大幅增加，在此预期下，外汇占款连续下降；经济短期下行和长期健康增长的平衡成为政府调控政策的主要着力点，调结构和稳增长的目标切换成为左右政策面的主要因素。由此，债券市场经历了货币政策从上半年的对冲式调整到下半年连续降息降准，短端利率大幅下降。随着短端的下行，长端下行空间继续打开，全年下来，债券市场收益率呈现大幅平坦化下移的态势。本基金在对货币放松的判断上，上半年通过保持较长久期和现券配置确保了组合的收益水平，下半年则更加注重平衡，择机配置，全年收益率维持在合理区间内。

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4.0542%，同期业绩比较基准收益率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

2016年随着全球货币政策的分化，资产配置难度将有所增加。综合来看，美联储经历多年QE后的首次加息对全球流动性的影响十分显著；大宗物价在经历了连续下跌，并击穿工业成本线后，存在超跌反弹的可能性；国内来看，股灾影响仍然未消除，债券市场上的绝对收益率下行空间被压缩到历史低位，金融监管的调整也将对国内金融市场格局产生较大影响。

展望2016年，供给侧改革仍将有节奏的推进，但同时扩张经济总需求的各项政策也将陆续出台，以防止各项潜在风险。在供给侧改革和总需求管理的平衡上，预计货币政策仍将保持适度宽松，而经济目标的切换将成为影响债券市场行情的主要因素。此外，监管层对于金融市场的改革，尤其是对银行业的改革也将继续影响货币市场的流动性。货币基金新规的实施，对货币基金的流动性和安全性提出了较高的要求，未来本基金将更加着重精细化管理。

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年以上相关工作经历，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3,172,367,028.83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

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(16)第P0568号
备注	投资者可通过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：兴全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	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	35,058,445,196.03	36,883,887,713.68
结算备付金		17,588,095.24	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	28,513,624,404.41	18,682,315,561.49
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		28,411,624,404.41	18,682,315,561.49
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	7,276,003,833.99	1,097,532,846.31
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	540,724,267.34	918,599,690.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		71,406,385,797.01	57,582,335,812.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		2,227,997,285.00	2,416,749,254.85
应付证券清算款		1,600,000,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		16,236,923.13	14,793,312.90
应付托管费		3,006,837.63	2,739,502.41
应付销售服务费		15,034,188.11	4,427,534.92
应付交易费用	7.4.7.7	361,670.22	459,410.20
应交税费		-	-
应付利息		282,215.24	1,599,315.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	295,000.00	129,000.00
负债合计		3,863,214,119.33	2,440,897,330.96
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	67,543,171,677.68	55,141,438,481.19
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		67,543,171,677.68	55,141,438,481.19
负债和所有者权益总计		71,406,385,797.01	57,582,335,812.15

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额67,543,171,677.68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：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入		3,713,824,118.38	2,643,022,466.66
1.利息收入		3,525,208,155.21	2,504,523,060.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,500,440,888.15	2,027,947,951.34
债券利息收入		861,143,830.33	441,581,610.39
资产支持证券利息收入		1,484,606.69	-
买入返售金融资产收入		162,138,830.04	34,993,498.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		188,510,777.17	138,488,005.22
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	188,510,777.17	138,488,005.22
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.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	11,400.80
减：二、费用		541,457,089.55	405,399,988.24
1．管理人报酬	7.4.9.2.1	220,027,570.21	125,887,397.41
2．托管费	7.4.9.2.2	40,745,846.40	23,312,480.93
3．销售服务费	7.4.9.2.3	203,729,231.78	116,562,405.01
4．交易费用	7.4.7.19	-	-
5．利息支出		76,383,112.92	139,201,554.77
其中：卖出回购金融资产支出		76,383,112.92	139,201,554.77
6．其他费用	7.4.7.20	571,328.24	436,150.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,172,367,028.83	2,237,622,478.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,172,367,028.83	2,237,622,478.42

注：本基金合同于2014年2月27日生效，上年度可比期间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：兴全添利宝货币市场基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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

项目	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014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）	1,306,102,190.00	-	1,306,102,190.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,237,622,478.42	2,237,622,478.42
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）	53,835,336,291.19	-	53,835,336,291.19
其中：1.基金申购款	471,407,816,428.88	-	471,407,816,428.88
2.基金赎回款	-417,572,480,137.69	-	-417,572,480,137.69
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）	-	-2,237,622,478.42	-2,237,622,478.42
五、期末所有者权益（基金净值）	55,141,438,481.19	-	55,141,438,481.19

注：本基金合同于2014年2月27日生效，上年度可比期间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：

______兰荣______　　______杨东______　　____詹鸿飞____

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”)系由基金管理人兴业全球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[2015]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业全球基金管理有限公司，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2015年12月31日的财务状况以及2015年1月1日至2015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 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

-

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

根据中国证券投资基金业协会发布的《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发(2014)24 号)的要求，本基金本报告期交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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》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) 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。

(3) 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
兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴业全球基金”）	基金管理人，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。

7.4.8 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债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014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	33,135,928,000.00	100.00%	23,367,297,000.00	100.00%

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均无应付关联方的佣金。

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	220,027,570.21	125,887,397.41
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1、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。

2、本基金合同于2014年2月27日生效，上期数据按实际存续期计算。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	40,745,846.40	23,312,480.93

注：1、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。

2、本基金合同于2014年2月27日生效，上期数据按实际存续期计算。

7.4.8.2.3 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 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
兴业全球基金管理有限公司	203,729,231.78
合计	203,729,231.78
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业全球基金管理有限公司	116,562,405.01
合计	116,562,405.01

注：1、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。

2、本基金合同于2014年2月27日生效，上期数据按实际存续期计算。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
	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

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
	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	211,012,000.27	286,932,525.62	-	-	4,603,210,000.00	1,801,662.37

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金合同生效日（2014年2月27日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	303,300,793.87	-
期间申购/买入总份额	1,404,219,301.31	609,300,793.87
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	1,168,000,000.00	306,000,000.00
期末持有的基金份额	539,520,095.18	303,300,793.87
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.7988%	0.5500%

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。

7.4.8.4.2 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 2015年12月31日		上年度末 2014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	719,307,320.80	1.0650%	500,713,425.22	0.0908%
兴全睿众	44,079,012.99	0.0653%	8,332,844.85	0.0151%
兴业银行	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。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年2月27日(基金合同生效日)至2014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	10,741,095,196.03	614,492,125.67	12,053,887,713.68	875,775,282.29

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间无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

无。

7.4.9 期末（ 2015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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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清款余额2,227,997,285.00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
041554014	15新希望CP001	2016年1月4日	100.79	2,000,000	201,570,922.86
041559030	15东南网架CP001	2016年1月4日	99.98	300,000	29,994,508.45
041564011	15甘公投CP001	2016年1月4日	100.46	800,000	80,364,138.65
041572009	15绵阳投控CP002	2016年1月4日	100.23	1,000,000	100,225,373.16
150211	15国开11	2016年1月4日	100.06	1,000,000	100,060,693.88
150311	15进出11	2016年1月4日	99.84	5,000,000	499,188,704.63
150413	15农发13	2016年1月4日	99.85	4,200,000	419,361,426.84
111512071	15北京银行CD071	2016年1月5日	99.33	5,000,000	496,646,303.25
111591886	15宁波银行CD107	2016年1月5日	99.19	3,400,000	337,259,885.55
合计				22,700,000	2,264,671,957.27

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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相差很小。

(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2015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28,513,624,404.41　　元，无属于第一层次和第三层次的余额(2014年12月31日：第二层次的余额为18,682,315,561.49元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(b)以公允价值计量的金融工具-续

(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。

如本财务报告7.4.5.2 部分所述，本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本年变动金额

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	28,513,624,404.41	39.93
	其中：债券	28,411,624,404.41	39.79
	资产支持证券	102,000,000.00	0.14
2	买入返售金融资产	7,276,003,833.99	10.19
	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	35,076,033,291.27	49.12
4	其他各项资产	540,724,267.34	0.76
5	合计	71,406,385,797.01	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	3.89	
	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	2,227,997,285.00	3.30
	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????????	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

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。

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	25.08	5.67
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	12.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	29.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.09	-
4	90天(含)—180天	29.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天（含）	8.56	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.91	5.67

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	4,441,136,421.83	6.58
	其中：政策性金融债	4,441,136,421.83	6.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,712,949,568.97	15.86
6	中期票据	2,253,124,628.97	3.34
7	同业存单	11,004,413,784.64	16.29
8	其他	-	-
9	合计	28,411,624,404.41	42.06
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	58,323,577.06	0.09

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	111510315	15兴业CD315	20,000,000	1,984,837,310.06	2.94
2	111510435	15兴业CD435	11,000,000	1,092,941,842.77	1.62
3	111511245	15平安CD245	10,000,000	991,985,043.44	1.47
4	111519064	15恒丰银行CD064	10,000,000	991,554,091.18	1.47
5	111513112	15浙商CD112	10,000,000	991,266,732.54	1.47
6	111591888	15宁波银行CD108	10,000,000	982,518,455.58	1.45
7	111519063	15恒丰银行CD063	6,000,000	595,106,483.07	0.88
8	150413	15农发13	5,800,000	579,118,160.88	0.86
9	150403	15农发03	5,600,000	560,502,414.62	0.83
10	011574004	15陕煤化SCP004	5,000,000	499,960,924.21	0.74

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	0.2082%
报告期内偏离度的最低值	0.0507%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1262%

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

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	1589152	15恒金1A1	1,200,000	102,000,000.00	0.15

8.8 投资组合报告附注

8.8.1

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。

8.8.2

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。

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，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4 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	540,724,267.34
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	540,724,267.34

8.8.5 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。

§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
547,769	123,305.94	33,840,341,801.48	50.10%	33,702,829,876.20	49.90%

9.3 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	23,341,231.36	0.0346%

9.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§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	55,141,438,481.19
本报告期基金总申购份额	573,531,156,008.22
减：本报告期基金总赎回份额	561,129,422,811.73
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	67,543,171,677.68

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）报告期内基金管理人重大人事变动：

2015年3月26日公告，公司副总经理徐天舒于2015年3月24日起离任；

2015年4月30日公告，公司副总经理董承非于2015年4月30日起任职，公司副总经理杜昌勇于2015年4月30日起离任；

2015年6月4日公告，公司副总经理傅鹏博于2015年6月4日起任职。

（2）报告期内本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2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	-	-	33,135,928,000.00	100.00%	-	-

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%。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司

2016年3月25日