

兴业添天盈货币市场基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告期截至日期：2015年12月22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。

基金托管人及代理人通过份额有限公司根据本基金合同的规定，于2016年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、利润分配情况、持有人数、持有人户数、持有人结构等数据。

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，投资者在做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2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴业添天盈货币
交易代码	000624
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
报告期末基金份额总额	10,025,303,780.00份
投资目标	本基金在严格控制本金和流动性风险的前提下，通过主动管理，力求获得超越基准的稳定收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济形势、信用利差变化趋势和资金面状况，利用久期分析和现金流匹配法，对短期利率债、货币市场基金、同业存单基金及股票型基金等品种进行配置。
业绩比较基准	本基金的业绩基准为七天通知存款的收益率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属低风险品种，其预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
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
下属分级基金的基金简称	兴业添天盈货币A
下属分级基金的交易代码	000624
报告期末下属分级基金的份额总额	17,538,000份
10,025,286,247.01份	

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
1. 本期已实现收益		10,000.00	
2. 本期利润		10,000.00	
3. 期末基金资产净值		26,066,695.02	
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，本期公允价值变动收益为零，所以本期实现收益和本期利润的金额相等。		17,538,000份	
3.2.1 本基金报告期份额净值增长率相对比基准收益率的比较		兴业添天盈货币A	
阶段		净资产收益率(%)	净值收益率标准差(%)
过去三个月		0.0202%	0.0303%
注：本基金收益分配为按日结转份额。		0.0000%	0.0212%
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		兴业添天盈货币A	
注：1.本基金基金合同于2015年7月23日成立，截至报告期末本基金合同尚未满一年。 2.根据本基金基金合同约定，基金合同成立后6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。		兴业添天盈货币B	
4.1 管理人报告		基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名		任本基金的基金经理	证券从业年限
徐莹		本基金基金经理 本基金经办人 本基金经办人 本基金经办人	2015年7月23日
杨海君		本基金的基金经理 本基金经办人	2015年11月9日
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的情况说明		本基金报告期内严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。	
4.3 公平交易制度的执行情况		4.3.1 公平交易制度的执行情况	
4.3.1 公平交易制度的执行情况		本基金报告期内严格执行《证券投资基金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执行交易公平公开，公平对待旗下管理的基金和投资组合。	
4.3.2 异常交易行为的专项说明		4.3.2 异常交易行为的专项说明	
4.4 报告期内本基金的绩效考核结果		4.4 报告期内本基金的绩效考核结果	
4.4.1 报告期内本基金的绩效考核和运作评价		4.4.1 报告期内本基金的绩效考核和运作评价	
4.4.2 报告期内本基金的绩效考核和运作评价		4.4.2 报告期内本基金的绩效考核和运作评价	
4.5 其他需要说明的事项		4.5 其他需要说明的事项	
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明		4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	

注：1.本基金基金合同于2015年7月23日成立，截至报告期末本基金合同尚未满一年。

2.根据本基金基金合同约定，基金合同成立后6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.4 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

徐莹 本基金基金经理
本基金经办人
本基金经办人
本基金经办人

2015年7月23日 - 7

杨海君 本基金的基金经理
本基金经办人

2015年11月9日 - 5

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的情况说明

本基金报告期内严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内严格执行《证券投资基金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执行交易公平公开，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金的绩效考核结果

4.4.1 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.4.2 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.5 其他需要说明的事项

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：1.本基金基金合同于2015年7月23日成立，截至报告期末本基金合同尚未满一年。

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使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.4 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

徐莹 本基金基金经理
本基金经办人
本基金经办人
本基金经办人

2015年7月23日 - 7

杨海君 本基金的基金经理
本基金经办人

2015年11月9日 - 5

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的情况说明

本基金报告期内严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内严格执行《证券投资基金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执行交易公平公开，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金的绩效考核结果

4.4.1 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.4.2 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.5 其他需要说明的事项

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：1.本基金基金合同于2015年7月23日成立，截至报告期末本基金合同尚未满一年。

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使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.4 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

徐莹 本基金基金经理
本基金经办人
本基金经办人
本基金经办人

2015年7月23日 - 7

杨海君 本基金的基金经理
本基金经办人

2015年11月9日 - 5

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的情况说明

本基金报告期内严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内严格执行《证券投资基金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执行交易公平公开，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金的绩效考核结果

4.4.1 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.4.2 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.5 其他需要说明的事项

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

注：1.本基金基金合同于2015年7月23日成立，截至报告期末本基金合同尚未满一年。

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使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.4 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

徐莹 本基金基金经理
本基金经办人
本基金经办人
本基金经办人

2015年7月23日 - 7

杨海君 本基金的基金经理
本基金经办人

2015年11月9日 - 5

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信的情况说明

本基金报告期内严格执行《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内严格执行《证券投资基金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执行交易公平公开，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.4 报告期内本基金的绩效考核结果

4.4.1 报告期内本基金的绩效考核和运作评价

4.4.2 报告期内本基金的绩效考核和运作评价