

# 兴全货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 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：2018 年 8 月 28 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。本半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 2018 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9

<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	42
7.8 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
7.9 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.4 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 .....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	47
10.9 其他重大事件 .....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全货币市场证券投资基金	
基金简称	兴全货币	
场内简称	-	
基金主代码	340005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 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	24,394,118,858.91 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	-	
下属分级基金的基金简称:	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	340005	004417
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	8,784,794,560.34 份	15,609,324,298.57 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上,使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等,使基金收益达到同期货币市场的收益水平,力争超越业绩比较基准。	
投资策略	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	税后 6 个月银行定期存款利率	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。	
	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。

## 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	杨卫东	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	yangwd@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 28-30 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		兰荣	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
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	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
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 28-30 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日 )	报告期( 2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	180,057,983.81	391,477,033.06
本期利润	180,057,983.81	391,477,033.06

本期净值收益率	2.2159%	2.3370%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	8,784,794,560.34	15,609,324,298.57
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
累计净值收益率	47.3243%	5.8105%

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、本基金收益分配按月结转份额。

## 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

#### 兴全货币 A 类

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
过去一个月	0.3547%	0.0008%	0.1068%	0.0000%	0.2479%	0.0008%
过去三个月	1.0740%	0.0019%	0.3241%	0.0000%	0.7499%	0.0019%
过去六个月	2.2159%	0.0015%	0.6447%	0.0000%	1.5712%	0.0015%
过去一年	4.4592%	0.0013%	1.3000%	0.0000%	3.1592%	0.0013%
过去三年	11.5805%	0.0036%	4.0207%	0.0003%	7.5598%	0.0033%
自基金合同生效起至今	47.3243%	0.0056%	27.7077%	0.0021%	19.6166%	0.0035%

#### 兴全货币 B 类

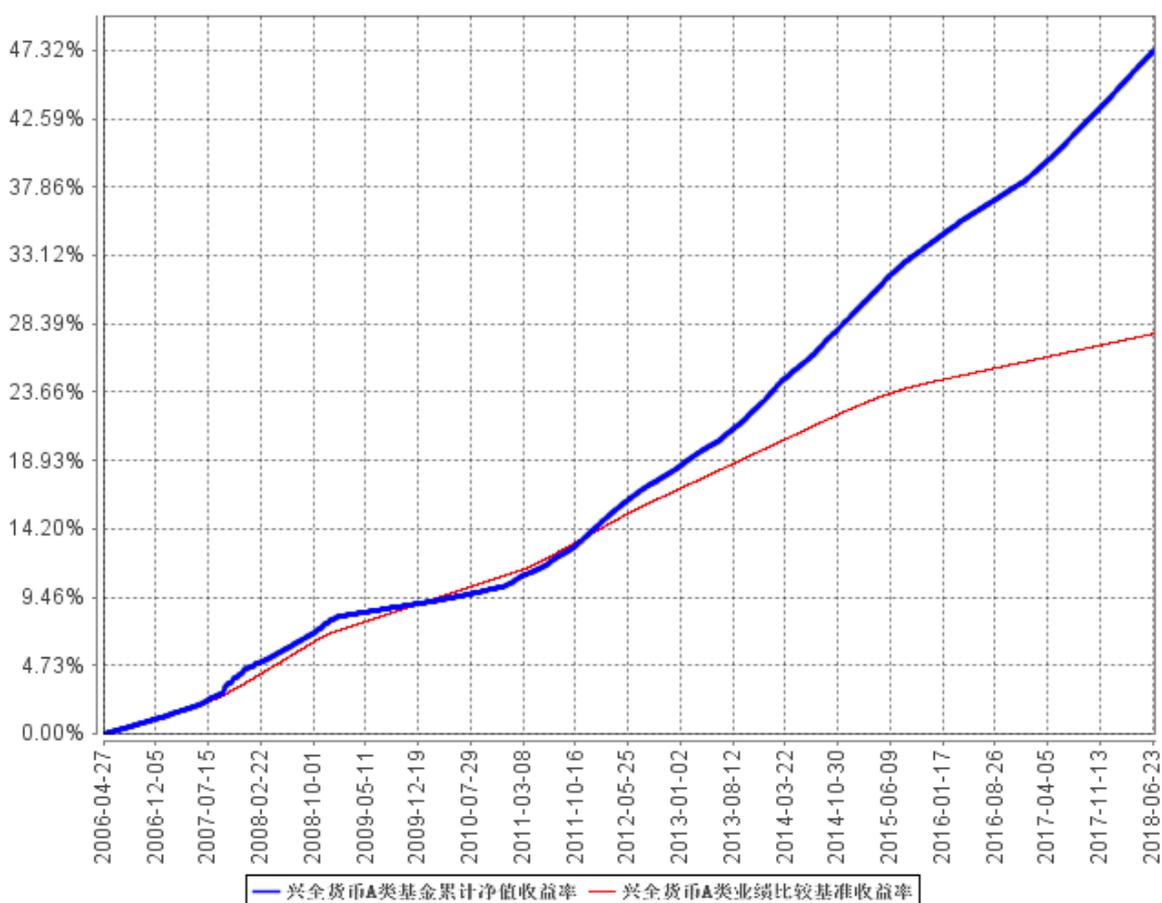
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3744%	0.0008%	0.1068%	0.0000%	0.2676%	0.0008%
过去三个月	1.1343%	0.0019%	0.3241%	0.0000%	0.8102%	0.0019%
过去六个月	2.3370%	0.0015%	0.6447%	0.0000%	1.6923%	0.0015%
过去一年	4.7085%	0.0013%	1.3000%	0.0000%	3.4085%	0.0013%
自基金合同生效起至今	5.8105%	0.0012%	1.6099%	0.0000%	4.2006%	0.0012%

注：1、本基金业绩比较基准为税后 6 个月银行定期存款利率，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。

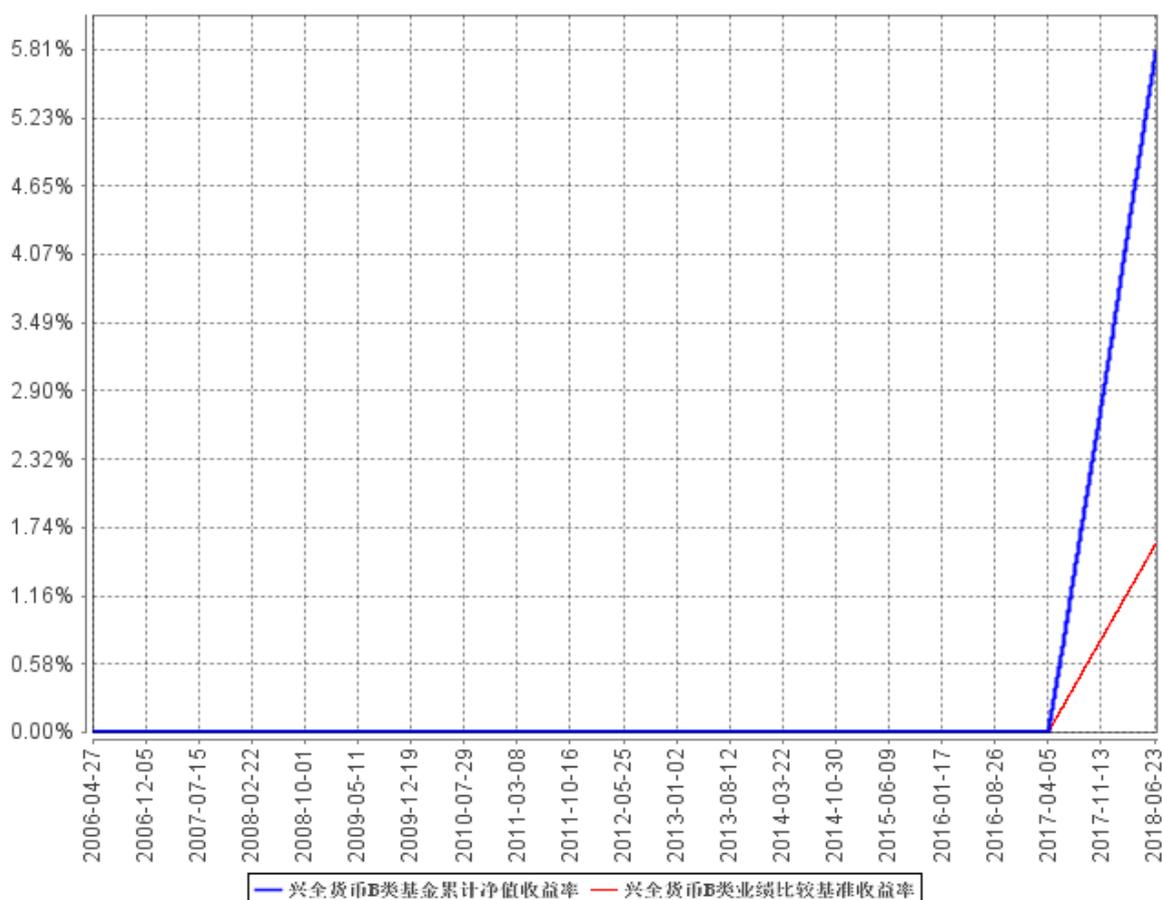
2、本基金于 2017 年 3 月 31 日召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于修改兴全货币市场证券投资基金费率、增设 B 类份额等有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会决议，管理人决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额，B 类份额自 2017 年 4 月 5 日起始运作。详情请见管理人网站公告。

### 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

兴全货币A类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



## 兴全货币B类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 2018 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全货币市场证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2006 年 4 月 27 日至 2006 年 10 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、本基金于 2017 年 3 月 31 日召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于修改兴全货币市场证券投资基金费率、增设 B 类份额等有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会决议，管理人决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额，B 类份额自 2017 年 4 月 5 日起始运作。详情请见管理人网站公告。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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 2018 年 6 月 30 日，公司旗下管理着二十二只基金，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）、兴全精选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、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
谢芝兰	本基金基金经理	2016 年 4 月 22 日	-	6 年	经济学硕士。历任信诚基金管理有限公司交易员，兴全

					基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。
季伟杰	本基金基金经理助理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理助理	2017年6月23日	-	4年	金融学博士，历任天津银行股份有限公司任博士后研究，中信建投证券研究发展部宏观债券团队债券分析师，兴全基金管理有限公司固定收益部研究员。

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、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》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。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体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。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

#### 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 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

2018 年上半年债券收益率先上后下，整体来看是走出了一个大牛市，年初在多方利空因素推动下债券收益率达到 2016 年底转熊以来最高点，春节后开始此前利空因素均出现转向或边际改善，促使债市收益率震荡中大幅下行，截止半年末已回到去年年初的水平。去年以来经济结构逐渐改善，投资对经济增长的贡献逐渐降低，经济韧性增强。但在去杠杆、防风险等重大任务驱使下，金融监管在年初进一步升级，对影子银行各环节的严厉打击使得融资渠道萎缩，社融增速频现低位，信用违约事件增加，资金来源受阻最终对实体经济产生影响。此外，贸易摩擦逐渐升温，贸易摩擦、逆全球化对出口的影响给国内经济带来较大压力和不确定性。面临上述内忧外患，政策层面均先后出现边际改善，首先货币政策由紧中性转为稳健，保持流动性合理稳定转为合理充裕，上半年实施了三次定向降准，MLF 超量续作，银行超储率在二季度出现明显回升，整个上半年资金面较去年明显宽松。监管政策方面，资管新规正式稿出台后，相关细则受贸易战升级影响，推出时间延后，且对于过渡期内的投资操作较之前出现明显放松。宽货币到宽信用的传导疏通上，央行也频频出招，包括窗口指导放松信贷额度，MLF 增加低评级信用债抵押，表外非标投资放松，低评级主体信贷投放可获得 MLF 超量支持，MPA 考核指标放松，地方政府及城投平台融资出现松绑等。随着上述经济基本面及政策面的变化，债市收益率先上后下，曲线先陡峭化，后期限利差收缩，受信用风险事件的爆发，二季度信用债表现两级分化明显，部分领域以及低评级的信用利差大幅扩大，随着安抚政策的出台，信用利差止升并收缩。报告期内，本基金规模变化不大，投资操作上以资产到期续做为主。在信用违约事件频发以及期限利差较窄的情况下，主要选择高评级、流动性较好的短久期资产。在资金面维持宽松的情况下，杠杆增强效果较明显，保持适当杠杆水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期兴全货币 A 类的基金份额净值收益率为 2.2159%，本报告期兴全货币 B 类的基金份

额净值收益率为 2.3370%，同期业绩比较基准收益率为 0.6447%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济下行压力较大，面临的风险主要包括贸易战的不确定性对出口的影响，宽货币到款信用的疏通是否顺利，决定了下半年固定资产投资增速能否企稳回升。美国经济表现强劲，将保持加息趋势，近期受贸易摩擦的影响，人民币汇率出现大幅贬值且波动幅度加大，如果下半年国内经济承压货币政策延续宽松，中美利差进一步收窄，汇率压力降进一步加大，由于外汇管制措施，短期外汇流出压力不大，但长期压力难解，最终可能会对国内货币政策和利率走势形成掣肘。在稳增长的诉求下，宽松的货币政策似乎是必要条件，下半年流动性应无忧，资金面降延续宽松。由于基础利率的调整信号意义过强，下调的概率较小，若受制于此，短端收益率在当前水平上继续下行的空间非常有限，且部分期限利差已经压缩到极致，后面利差恢复的上行风险较大。下半年宽货币宽信用及积极财政政策的推动下，目前中高评级信用利差已经压缩到极致的情况下，性价比已经较低，中低评级行业龙头将受益于风险偏好缓慢回升，信用利差得到压缩。此外，长端已率先反应经济下行压力的利好，短端则在资金面极度宽松的推动下大幅下行至极低位置，中长端的性价比凸显。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》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，并按月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本基金 A 份额持有人分配利润 180,057,983.81 元，本基金本报告期内向本基金 B 份额持有人分配利润 391,477,033.06 元，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 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

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

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；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,606,394,268.81	10,783,844,914.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	10,197,642,829.91	11,498,851,981.65
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		10,197,642,829.91	11,498,851,981.65
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,105,815,738.72	5,303,589,185.42
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	145,756,280.47	142,816,271.31
应收股利		-	-
应收申购款		81,018,199.78	87,883,012.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		27,136,627,317.69	27,816,985,365.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,672,546,623.71	3,807,912,692.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,986,621.45	2,451,810.18
应付管理人报酬		3,895,661.07	3,839,753.66
应付托管费		1,082,128.08	1,066,598.18
应付销售服务费		2,001,300.03	1,662,335.79
应付交易费用	6.4.7.7	429,234.57	305,845.19

应交税费		105,465.34	-
应付利息		608,726.04	2,603,223.92
应付利润		59,773,910.66	62,748,148.59
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,787.83	124,992.08
负债合计		2,742,508,458.78	3,882,715,399.59
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	24,394,118,858.91	23,934,269,965.49
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		24,394,118,858.91	23,934,269,965.49
负债和所有者权益总计		27,136,627,317.69	27,816,985,365.08

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，兴全货币 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 8,784,794,560.34 份；兴全货币 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 15,609,324,298.57 份。兴全货币基金份额总额合计为 24,394,118,858.91 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018 年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年6月30日
<b>一、收入</b>		650,076,589.24	276,445,955.29
1.利息收入		650,676,791.96	281,382,300.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	286,368,265.66	171,118,531.97
债券利息收入		223,758,429.73	79,989,409.50
资产支持证券利息收入		-	45,954.60
买入返售金融资产收入		140,550,096.57	30,228,404.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-627,081.25	-4,936,345.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-627,081.25	-4,936,345.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	26,878.53	-
<b>减:二、费用</b>		78,541,572.37	38,261,424.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,451,029.50	14,130,867.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,236,397.19	4,133,008.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,022,162.22	8,387,195.09
4. 交易费用	6.4.7.19	325.00	245.17
5. 利息支出		38,625,891.48	11,443,114.50
其中: 卖出回购金融资产支出		38,625,891.48	11,443,114.50
6. 税金及附加		80,948.46	-
7. 其他费用	6.4.7.20	124,818.52	166,992.98
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		571,535,016.87	238,184,530.95
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		571,535,016.87	238,184,530.95

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 兴全货币市场证券投资基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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)	23,934,269,965.49	-	23,934,269,965.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	571,535,016.87	571,535,016.87
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)	459,848,893.42	-	459,848,893.42
其中: 1. 基金申购款	31,874,168,302.88	-	31,874,168,302.88
2. 基金赎回款	-31,414,319,409.46	-	-31,414,319,409.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-571,535,016.87	-571,535,016.87

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	24,394,118,858.91	-	24,394,118,858.91
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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）	3,836,615,449.01	-	3,836,615,449.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	238,184,530.95	238,184,530.95
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）	10,398,613,927.49	-	10,398,613,927.49
其中：1. 基金申购款	23,024,590,495.38	-	23,024,590,495.38
2. 基金赎回款	-12,625,976,567.89	-	-12,625,976,567.89
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）	-	-238,184,530.95	-238,184,530.95
五、期末所有者权益（基金净值）	14,235,229,376.50	-	14,235,229,376.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 兰荣	_____ 庄园芳	_____ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全货币市场证券投资基金(原名“兴业货币市场证券投资基金”)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意兴业货币市场证券投资基金募集的批复》(证监许可[2006]49号文)的核准,由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》及其配套规则等相关法规和《兴业货币市场证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2006 年 4 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,729,582,293.12 份基金份额。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为“兴全货币市场证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》和《兴全货币市场证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金投资范围是以下金融工具：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，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。

本基金的业绩比较基准为：税后 6 个月银行定期存款利率。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 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一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 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 号文《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 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税 [2017] 56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(c) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(d) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,394,268.81
定期存款	9,600,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	0.00
存款期限 1-3 个月	100,000,000.00
存款期限 3 个月以上	9,500,000,000.00
其他存款	-
合计：	9,606,394,268.81

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 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	10,197,642,829.91	10,211,918,975.88	14,276,145.97	0.0585%
	合计	10,197,642,829.91	10,211,918,975.88	14,276,145.97	0.0585%
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	10,197,642,829.91	10,211,918,975.88	14,276,145.97	0.0585%	

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	7,105,815,738.72	-
合计	7,105,815,738.72	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,687.66
应收定期存款利息	77,913,321.39
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	47,234,299.20
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	20,426,333.05
应收申购款利息	177,639.17
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	145,756,280.47

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	429,234.57
合计	429,234.57

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,322.87
预提费用	73,464.96
应付转换费	-
审计师费	-
账户服务费	-
上清所账户服务费	-
信息披露费	-
合计	78,787.83

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全货币 A 类		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,632,073,096.01	6,632,073,096.01
本期申购	17,101,552,804.05	17,101,552,804.05
本期赎回(以“-”号填列)	-14,948,831,339.72	-14,948,831,339.72
- 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	8,784,794,560.34	8,784,794,560.34

金额单位：人民币元

兴全货币 B 类		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,302,196,869.48	17,302,196,869.48
本期申购	14,772,615,498.83	14,772,615,498.83
本期赎回(以“-”号填列)	-16,465,488,069.74	-16,465,488,069.74
- 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	15,609,324,298.57	15,609,324,298.57

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全货币 A 类			
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	180,057,983.81	-	180,057,983.81
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	-180,057,983.81	-	-180,057,983.81
本期末	-	-	-

单位：人民币元

兴全货币 B 类			
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	391,477,033.06	-	391,477,033.06
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	-391,477,033.06	-	-391,477,033.06
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	123,375.79
定期存款利息收入	286,076,696.39
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	60.00
其他	168,133.48
合计	286,368,265.66

**6.4.7.12 股票投资收益**

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-627,081.25
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	-627,081.25

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	40,543,253,680.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,325,458,775.17
减：应收利息总额	218,421,986.23
买卖债券差价收入	-627,081.25

**6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他收入	26,878.53
合计	26,878.53

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	325.00
合计	325.00

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	34,712.18
其他	719.56
银行汇划费	41,334.00
账户服务费	18,300.00
银行费用	-
交易费用	-
合计	124,818.52

**6.4.7.21 分部报告**

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

权证不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**6.4.10.1.5 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支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,451,029.50	14,130,867.71
其中：支付销售机构的客户维护费	4,444,266.97	838,641.35

注：2017年1月1日-2017年3月30日，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提；2017年3月31日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的0.18%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×基金管理费率/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,236,397.19	4,133,008.89

注：2017年1月1日-2017年3月30日，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提；2017年3月31日起，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×基金托管费率/当年天数。

**6.4.10.2.3 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		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全货币A类	兴全货币B类	合计
兴全基金	621,463.53	764,727.48	1,386,191.01
兴业银行	151,266.29	4,157.58	155,423.87
兴业证券	305,942.16	5,773.95	311,716.11

合计	1,078,671.98	774,659.01	1,853,330.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类	合计
兴全基金	5,843,120.20	320,514.40	6,163,634.60
兴业证券	87,176.42	9.66	87,186.08
兴业银行	162,585.23	162.61	162,747.84
合计	6,092,881.85	320,686.67	6,413,568.52

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，由基金管理人支配使用。本报告期内本基金的 A 类份额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，本基金的 B 类份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 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×销售服务费率/当年天数。

#### 6.4.10.3 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 2018年1月1日至2018年6月30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	692,136,700.00	-	-	-	100,000,000.00	7,808.22
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	98,938,500.00	-	499,700,000.00	2,266,447.53	250,000,000.00	37,671.23

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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
	2018年1月1日至2018年6月30日

	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
期初持有的基金份额	-	552,568,869.81
期间申购/买入总份额	-	308,445,276.36
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	861,014,146.17
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	3.5296%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
期初持有的基金份额	46,271,983.05	-
期间申购/买入总份额	-	47,171,594.13
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	46,271,983.05	-
期末持有的基金份额	-	47,171,594.13
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.3314%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

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。

3、根据兴全货币市场证券投资基金基金份额持有人大会决议，本公司决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（原来的基金份额，代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额，若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

#### 6.4.10.4.2 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

兴全货币 A 类

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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

兴全睿众	-	-	-	-
兴业银行	-	-	4,057,420.92	0.0170%
兴业证券	-	-	-	-

## 兴全货币 B 类

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
兴全睿众	82,999,006.66	0.3402%	66,041,739.79	0.2759%
兴业银行	6,326,749,783.87	25.9356%	9,146,109,697.33	38.2134%
兴业证券	202,058,840.76	0.8283%	1,639,171,758.48	6.8486%

注：1、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。

2、根据兴全货币市场证券投资基金基金份额持有人大会决议，本公司决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（原来的基金份额，代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额。兴业银行下属两家分支机构分别持有本基金 A 类份额和 B 类份额。

## 6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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	706,394,268.81	2,498,375.79	3,258,378.25	23,149,155.78

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

## 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至本报告期末，管理人持有的关联方兴业银行发行的同业存单面额 700,000,000.00 元，估值总额 694,637,640.83 元。

注：管理人持有的关联方发行的同业存单估值总额按照摊余成本法计算。

## 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

## 兴全货币A类

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
164,844,038.76	11,331,192.70	3,882,752.35	180,057,983.81	-

## 兴全货币B类

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
384,260,446.59	14,073,576.75	-6,856,990.28	391,477,033.06	-

**6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期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。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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 2672546623.71 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
130245	13 国开 45	2018 年 7 月 2 日	100.49	1,800,000	180,873,146.99
150217	15 国开 17	2018 年 7 月 2 日	100.02	250,000	25,003,890.95
080214	08 国开 14	2018 年 7 月 3 日	100.32	300,000	30,094,887.17
130325	13 进出 25	2018 年 7 月 3 日	100.33	600,000	60,195,115.16
150217	15 国开 17	2018 年 7 月 3 日	100.02	1,100,000	110,017,120.20
111771386	17 广州银行 CD100	2018 年 7 月 4 日	98.92	700,000	69,242,456.12
111781884	17 广州农村商业银行	2018 年 7 月 4 日	99.62	400,000	39,846,880.06

	行 CD135				
111785310	17 杭州银行 CD194	2018 年 7 月 4 日	98.91	250,000	24,727,851.49
111893702	18 杭州银行 CD020	2018 年 7 月 4 日	98.97	400,000	39,588,109.96
111893594	18 齐鲁银行 CD048	2018 年 7 月 4 日	99.02	360,000	35,645,992.04
187703	18 贴现国开 03	2018 年 7 月 2 日	99.68	1,560,000	155,502,684.37
111821163	18 渤海银行 CD163	2018 年 7 月 2 日	99.46	1,000,000	99,464,713.63
111894499	18 重庆银行 CD061	2018 年 7 月 2 日	98.78	1,000,000	98,778,681.96
111895182	18 厦门国际银行 CD066	2018 年 7 月 2 日	99.88	1,800,000	179,778,539.18
080418	08 农发 18	2018 年 7 月 2 日	100.11	800,000	80,085,384.44
130245	13 国开 45	2018 年 7 月 2 日	100.49	1,100,000	110,533,589.83
150217	15 国开 17	2018 年 7 月 2 日	100.02	350,000	35,005,447.34
170207	17 国开 07	2018 年 7 月 2 日	99.98	3,400,000	339,921,456.71
187703	18 贴现国开 03	2018 年 7 月 2 日	99.68	640,000	63,795,973.08
111810263	18 兴业银行 CD263	2018 年 7 月 2 日	99.20	5,000,000	495,987,677.36
111719304	17 恒丰银行 CD304	2018 年 7 月 2 日	98.80	200,000	19,760,712.79
111719349	17 恒丰银行 CD349	2018 年 7 月 2 日	98.29	2,000,000	196,577,376.53
111819125	18 恒丰银行 CD125	2018 年 7 月 2 日	98.87	3,000,000	296,604,305.58
合计				28,010,000	2,787,031,992.94

#### 6.4.12.3.2 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面，风险管理部和监察稽核部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，为业务部门的风险管理系统的发展提供协助；各业务部门是风险管理的第一线，风险管理时业务部门的最首要责任。

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、风险管理部和监察稽核部、相关业务部门构成的风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	319,289,760.15	210,546,238.81
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	720,443,270.63	1,663,479,012.06
合计	1,039,733,030.78	1,874,025,250.87

注：此处的债券不包括国债、央票与政策性金融债。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期资产支持证券投资。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期同业存单投资。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	19,613,680.08	0.00
AAA 以下	50,048,266.94	80,513,873.20
未评级	0.00	0.00
合计	69,661,947.02	80,513,873.20

注：此处的债券不包括国债、央票与政策性金融债。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期资产支持证券投资。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	7,087,757,638.67	5,246,358,296.44
AAA 以下	749,462,945.65	2,281,055,733.98
未评级	0.00	-
合计	7,837,220,584.32	7,527,414,030.42

注：此处为主体信用评级。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时遇到资金短缺的风

险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金

所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回

购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，本基金前十名份额持有人持有基金份额比例超过基金总份额 50%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30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	1,256,394,268.81	8,050,000,000.00	300,000,000.00	-	-	-	9,606,394,268.81
交易性金融资产	2,076,843,740.88	5,663,791,295.31	2,457,007,793.72	-	-	-	10,197,642,829.91
买入返售金融资产	5,837,497,076.25	1,268,318,662.47	-	-	-	-	7,105,815,738.72
应收利息	-	-	-	-	-	145,756,280.47	145,756,280.47
应收申购款	11,187,495.03	-	-	-	-	69,830,704.75	81,018,199.78
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,181,922,580.97	14,982,109,957.78	2,757,007,793.72	-	-	215,586,985.22	27,136,627,317.69
负债							
卖出回购金融资产款	2,672,546,623.71	-	-	-	-	-	2,672,546,623.71
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,986,621.45	1,986,621.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,895,661.07	3,895,661.07
应付托管费	-	-	-	-	-	1,082,128.08	1,082,128.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,001,300.03	2,001,300.03

应付交易费用	-	-	-	-	-	429,234.57	429,234.57
应付利息	-	-	-	-	-	608,726.04	608,726.04
应付利润	-	-	-	-	-	59,773,910.66	59,773,910.66
应交税费	-	-	-	-	-	105,465.34	105,465.34
其他负债	-	-	-	-	-	78,787.83	78,787.83
负债总计	2,672,546,623.71	-	-	-	-	69,961,835.07	2,742,508,458.78
利率敏感度缺口	6,509,375,957.26	14,982,109,957.78	2,757,007,793.72	-	-	-145,625,150.15	24,394,118,858.91
上年度末 2017 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	833,844,914.41	7,090,000,000.00	2,860,000,000.00	-	-	-	10,783,844,914.41
交易性金融资产	499,179,126.55	5,568,757,047.60	5,430,915,807.50	-	-	-	11,498,851,981.65
买入返售金融资产	4,700,608,520.95	602,980,664.47	-	-	-	-	5,303,589,185.42
应收利息	-	-	-	-	-	142,816,271.31	142,816,271.31
应收申购款	33,922,276.32	-	-	-	-	53,960,735.97	87,883,012.29
资产总计	6,067,554,838.23	13,261,737,712.07	8,290,915,807.50	-	-	-196,777,007.28	27,816,985,365.08
负债							
卖出回购金融资产款	3,807,912,692.00	-	-	-	-	-	3,807,912,692.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,451,810.18	2,451,810.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,839,753.66	3,839,753.66
应付托管费	-	-	-	-	-	1,066,598.18	1,066,598.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,662,335.79	1,662,335.79
应付交易费用	-	-	-	-	-	305,845.19	305,845.19
应付利息	-	-	-	-	-	2,603,223.92	2,603,223.92
应付利润	-	-	-	-	-	62,748,148.59	62,748,148.59
其他负债	-	-	-	-	-	124,992.08	124,992.08
负债总计	3,807,912,692.00	-	-	-	-	74,802,707.59	3,882,715,399.59
利率敏感度缺口	2,259,642,146.23	13,261,737,712.07	8,290,915,807.50	-	-	-121,974,299.69	23,934,269,965.49

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 1%	25,654,830.17	38,649,366.78
	市场利率上升 1%	-25,423,801.29	-38,308,406.11

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

于本年末及上年末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	10,211,918,975.88	41.86	11,484,835,000.00	47.98
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,211,918,975.88	41.86	11,484,835,000.00	47.98

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于本年末和上年末均未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行市场价格风险的敏感性分析。

##### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	10,197,642,829.91	37.58
	其中: 债券	10,197,642,829.91	37.58
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,105,815,738.72	26.19
	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	9,606,394,268.81	35.40
4	其他各项资产	226,774,480.25	0.84
5	合计	27,136,627,317.69	100.00

### 7.2 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	10.52	
	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	2,672,546,623.71	10.96
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 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个交易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

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。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

### 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未发生超过 120 天的情况。

### 7.3.2 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	36.37	10.96
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	46.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	4.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		110.31	10.96

### 7.4 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未发生超过 240 天的情况。

### 7.5 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	1,251,027,267.79	5.13
	其中：政策性金融债	1,251,027,267.79	5.13

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,039,733,030.78	4.26
6	中期票据	69,661,947.02	0.29
7	同业存单	7,837,220,584.32	32.13
8	其他	-	-
9	合计	10,197,642,829.91	41.80
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 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	111895182	18 厦门国际银行 CD066	5,000,000	499,384,831.05	2.05
2	111810263	18 兴业银行 CD263	5,000,000	495,987,677.36	2.03
3	111898916	18 徽商银行 CD087	5,000,000	495,528,869.75	2.03
4	170207	17 国开 07	3,400,000	339,921,456.71	1.39
5	111891144	18 天津银行 CD020	3,000,000	298,934,901.91	1.23
6	111806142	18 交通银行 CD142	3,000,000	297,982,938.49	1.22
7	111803112	18 农业银行 CD112	3,000,000	297,612,002.40	1.22
8	111899111	18 盛京银行 CD222	3,000,000	297,268,301.32	1.22
9	111819125	18 恒丰银行 CD125	3,000,000	296,604,305.58	1.22
10	130245	13 国开 45	2,900,000	291,406,736.82	1.19

## 7.7 “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	0.1267%
报告期内偏离度的最低值	0.0102%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0555%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内本基金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

报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

## 7.8 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。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1

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。

### 7.9.2

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。

### 7.9.3 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	145,756,280.47
4	应收申购款	81,018,199.78
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	226,774,480.25

### 7.9.4 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。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴全货币A类	435,433	20,174.85	177,662,792.05	2.02%	8,607,131,768.29	97.98%
兴全货币B类	192	81,298,564.06	14,875,594,201.86	95.30%	733,730,096.71	4.70%
合计	435,625	55,997.98	15,053,256,993.91	61.71%	9,340,861,865.00	38.29%

注：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（即期末基金份额总数）。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	6,326,749,783.87	25.94
2	银行类机构	814,782,732.12	3.34
3	基金类机构	717,603,201.48	2.94
4	信托类机构	350,788,569.55	1.44
5	银行类机构	321,618,909.98	1.32
6	券商类机构	312,032,248.91	1.28
7	银行类机构	311,577,414.85	1.28
8	券商类机构	306,223,667.74	1.26
9	其他机构	301,260,658.03	1.23
10	银行类机构	236,511,659.75	0.97

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	兴全货币A类	13,197,590.66	0.1502%
	兴全货币B类	-	-
	合计	13,197,590.66	0.0541%

注：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（即期末基金份额总数）。

#### 8.4 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	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	兴全货币 A 类	>100
	兴全货币 B 类	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全货币 A 类	0~10
	兴全货币 B 类	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
基金合同生效日（2006 年 4 月 27 日）基金份额总额	1,729,582,293.12	-
本报告期期初基金份额总额	6,632,073,096.01	17,302,196,869.48
本报告期基金总申购份额	17,101,552,804.05	14,772,615,498.83
减：本报告期基金总赎回份额	14,948,831,339.72	16,465,488,069.74
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	8,784,794,560.34	15,609,324,298.57

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

## 10.2 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。  
 2018 年 3 月 21 日公告，自 2018 年 3 月 21 日起傅鹏博先生不再担任副总经理职务。  
 2018 年 5 月 11 日公告，自 2018 年 5 月 11 日起陈锦泉先生担任副总经理。  
 2018 年 6 月 14 日公告，自 2018 年 6 月 12 日起，公司督察长由冯晓莲女士变更为杨卫东先生，杨卫东先生不再担任副总经理职务。  
 (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。

## 10.3 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。

## 10.4 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。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 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、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	1	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 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 2017 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 1 月 1 日
2	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2018 年第 1 号）	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 1 月 10 日
3	关于设立上海分公司的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 1 月 10 日
4	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2018 年第 2 号）	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 2 月 12 日
5	关于兴全货币市场基金暂停接受五千万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 3 月 5 日
6	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2018 年第 3 号）	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 3 月 12 日
7	关于增加上海基煜为兴全货币基金销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 3 月 14 日
8	关于解聘副总经理的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 3 月 21 日
9	关于修改旗下部分基金基金合同、托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 3 月 23 日
10	关于兴全货币市场基金暂停接受两百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 4 月 9 日
11	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2018 年第 4 号）	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 4 月 10 日
12	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2018 年第 5 号）	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 5 月 10 日
13	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 5 月 11 日
14	关于网上直销开通“汇收付”业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 5 月 16 日
15	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2018 年第 6 号）	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 6 月 11 日
16	关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 6 月 13 日
17	关于兴全货币市场基金暂停接受五百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、基金管理人网站	2018 年 6 月 15 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018 年 1 月 1 日 - 6 月 30 日	9,146,109,697.33	680,640,086.54	3,500,000,000.00	6,326,749,783.87	25.94%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>由于单一机构占比高，如果出现集中大额赎回，对产品流动性冲击较大，且可能影响其他投资者的收益。投资策略上已充分考虑到流动性需求，组合久期一直比较短，资产流动性较高，且同时关注申赎情况。</p>							

注：1、“申购金额”指分红再投资导致投资者持有份额增加的情形。

- 2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全货币市场证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全货币市场证券投资基金更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 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

2018年8月28日