

# 兴全货币市场证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 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：2019 年 3 月 28 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 2019 年 3 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。

本报告期自 2018 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	兴全货币	
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	26,671,061,170.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类
下属分级基金的交易代码:	340005	004417
报告期末下属分级基金的份额总额	6,872,870,200.14 份	19,798,190,970.46 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	本基金通过对货币市场短期金融工具的积极稳健投资,在风险和收益中寻找最优组合,在保持本金安全与资产充分流动性的前提下,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,追求稳定的现金收益。	
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基金、债券型基金和混合型基金。	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基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	龚小武
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212056
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	011597@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	<a href="http://www.xcfunds.com">http://www.xcfunds.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

## § 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	2018 年		2017 年		2016 年
	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类	兴全货币 A 类
本期已实现收益	316,975,889.70	734,439,085.40	244,200,251.57	461,741,738.56	67,720,764.25
本期利润	316,975,889.70	734,439,085.40	244,200,251.57	461,741,738.56	67,720,764.25
本期净值收益率	3.9688%	4.2178%	4.2247%	3.3942%	2.9246%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末
	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类	兴全货币 A 类	兴全货币 B 类	兴全货币 A 类
期末基金资产净值	6,872,870,200.14	19,798,190,970.46	6,632,073,096.01	17,302,196,869.48	3,836,615,449.01
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	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
过去三个月	0.7813%	0.0016%	0.3277%	0.0000%	0.4536%	0.0016%
过去六个月	1.7149%	0.0026%	0.6553%	0.0000%	1.0596%	0.0026%
过去一年	3.9688%	0.0026%	1.3000%	0.0000%	2.6688%	0.0026%
过去三年	11.5302%	0.0033%	3.9036%	0.0000%	7.6266%	0.0033%
过去五年	21.6382%	0.0045%	8.5926%	0.0017%	13.0456%	0.0028%
自基金合同生效起至今	49.8507%	0.0055%	28.3630%	0.0021%	21.4877%	0.0034%

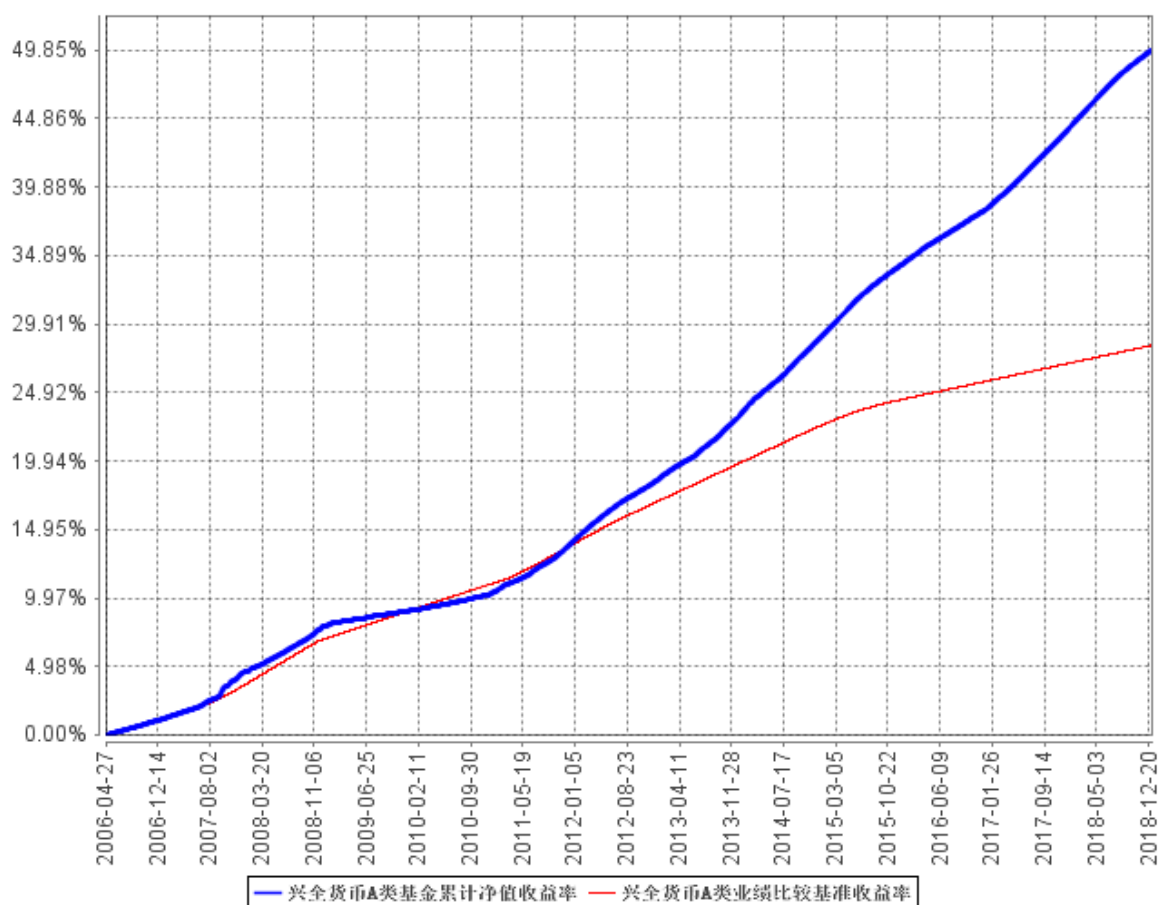
兴全货币 B 类

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
过去三个月	0.8421%	0.0016%	0.3277%	0.0000%	0.5144%	0.0016%
过去六个月	1.8378%	0.0026%	0.6553%	0.0000%	1.1825%	0.0026%
过去一年	4.2178%	0.0026%	1.3000%	0.0000%	2.9178%	0.0026%
自基金合同生效起至今	7.7551%	0.0021%	2.2652%	0.0000%	5.4899%	0.0021%

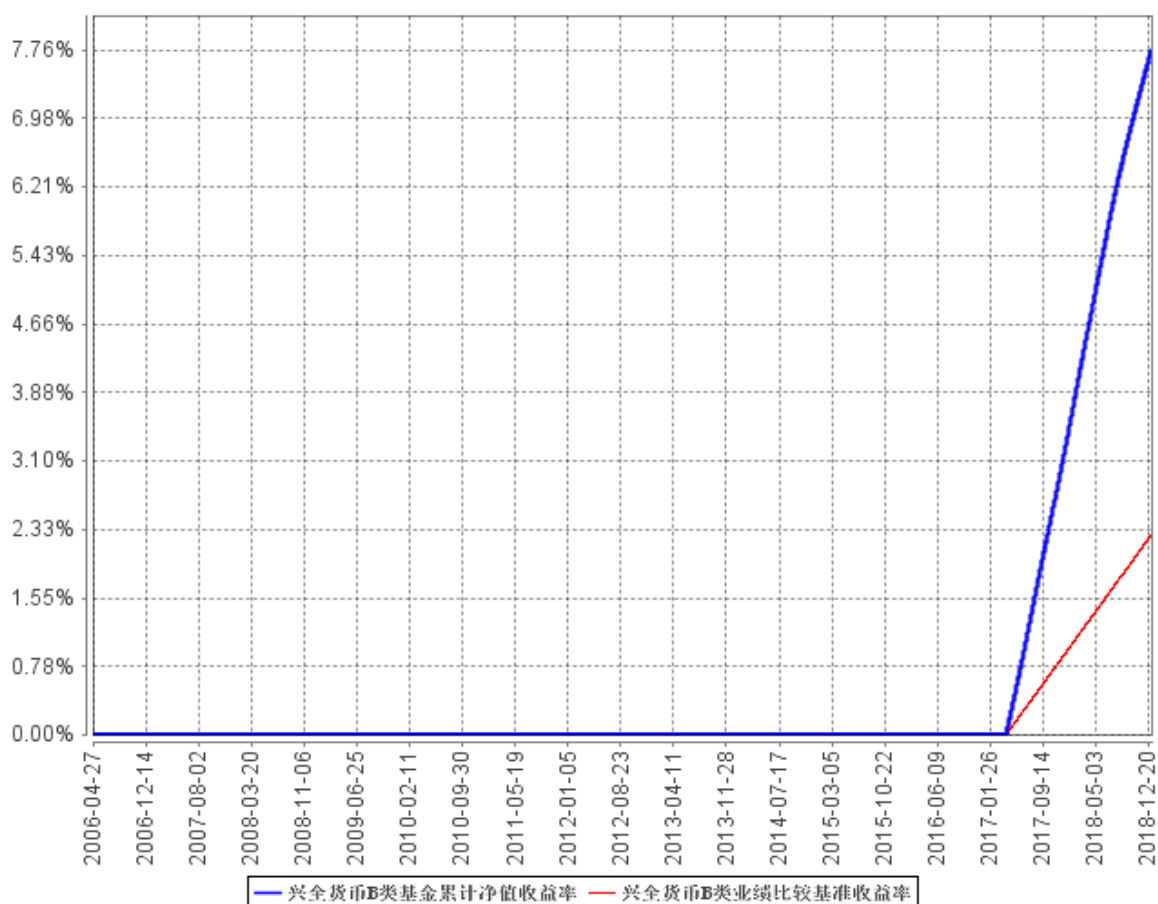
注：本基金业绩比较基准为税后 6 个月银行定期存款利率，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴业全球基金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

### 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



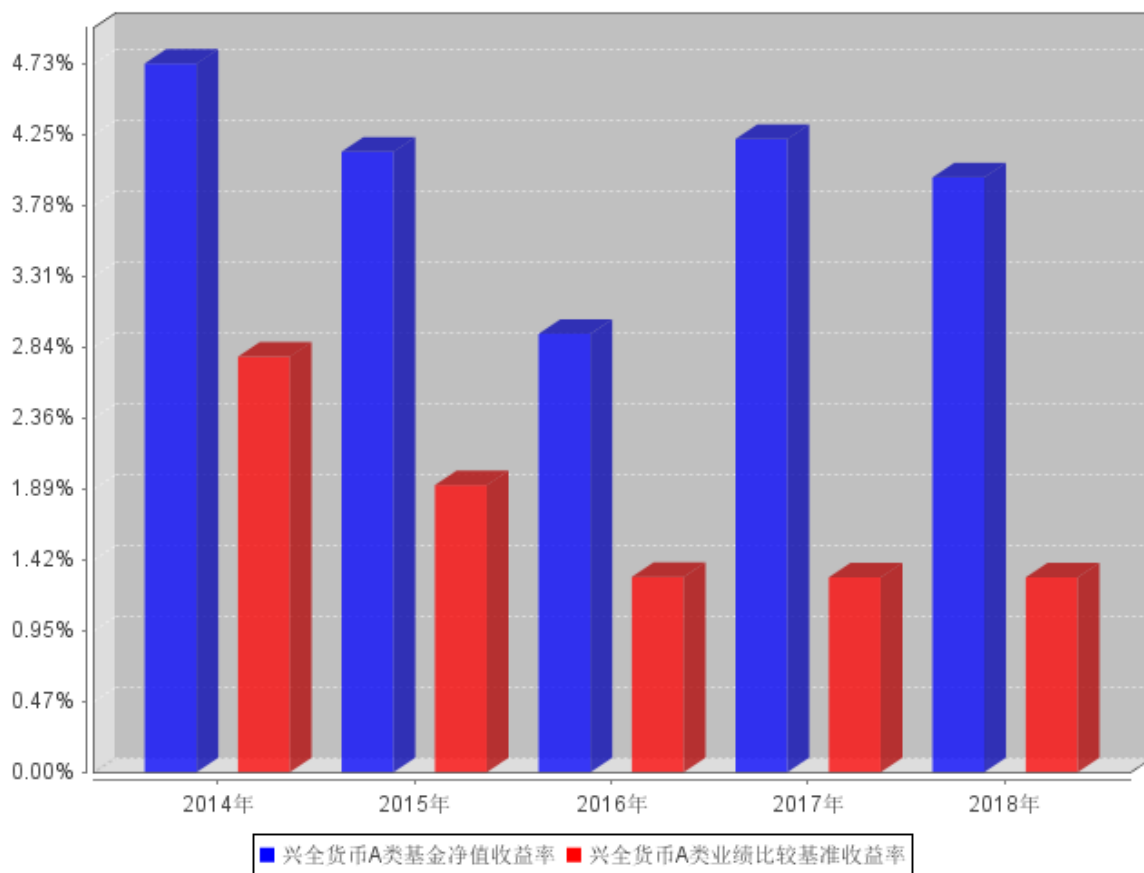
注：1、净值表现所取数据截至到 2018 年 12 月 31 日。

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。

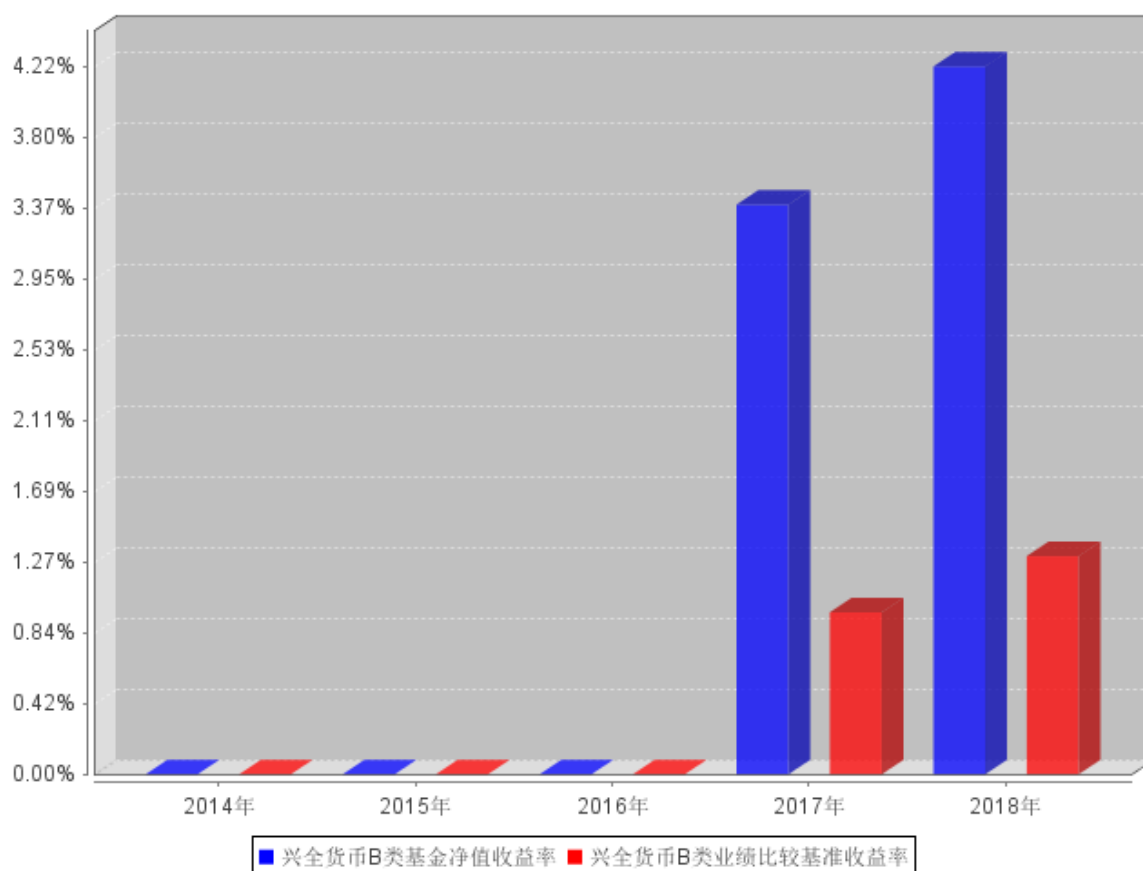


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全货币A类过去五年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



兴全货币B类过去五年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：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 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

兴全货币 A 类					
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
2018	302,220,808.18	20,567,299.59	-5,812,218.07	316,975,889.70	
2017	219,774,778.24	11,018,838.73	13,406,634.60	244,200,251.57	
2016	63,442,238.94	3,983,813.01	294,712.30	67,720,764.25	
合计	585,437,825.36	35,569,951.33	7,889,128.83	628,896,905.52	

单位：人民币元

兴全货币 B 类					
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

2018	711,564,039.10	25,886,273.14	-3,011,226.84	734,439,085.40	
2017	414,921,347.61	1,013,445.21	45,806,945.74	461,741,738.56	
合计	1,126,485,386.71	26,899,718.35	42,795,718.90	1,196,180,823.96	

## § 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12月31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	2017年6月	-	4年	金融学博士，历任

	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	23 日			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

2018 年经济在多重因素扰动下缓慢下行，地方政府债务延续严监管，资金来源受阻致使基建投资增速大幅下降，房价、股价带来的财富效应退却，加上前期需求透支，消费需求下滑明显，贸易摩擦不断升级叠加海外经济增速放缓对出口带来较大拖累，地产销售不断降温，但受益于棚改及低库存，地产投资仍具韧性，使得经济不至于失速下滑。金融领域严监管对实体经济融资的影响给经济带来的伤害不断显现，监管态度因此出现变化，年初监管政策频发到落地放缓再到监管边际放松。随着经济金融数据不断低于预期，加上贸易摩擦意外爆发，对未来经济的预期悲观，货币政策在二季度明确转向，连续降准加上公开市场超额投放，对流动性目标由合理稳定变为合理充裕。受之前对金融领域监管、处罚过严影响，风险偏好回升慢，宽货币政策传导受阻，社融增速不断下行，三季度宽信用政策不断出台，财政政策更加积极，地方债发行加速，针对民企的多项纾困措施相继落地。随着原油及其他大宗商品价格先上后大幅下降，以及下半年猪瘟爆发，食品价格低迷，通胀压力明显降低。贸易摩擦的不断升级，国内经济增速放缓，全年人民币贬值压力较大，对国内货币政策形成制约。

全年债券收益率一路下行，直逼 2016 年低点，息差、期限利差和信用利差整体也压缩至历史低位。年初对经济惯性乐观预期以及严监管政策频发，债市情绪延续谨慎，收益率出现短暂快速上行，此后随着流动性持续改善、经济金融数据低于预期以及贸易摩擦的意外爆发，债市情绪得以扭转，开启全年牛市之旅。二季度随着货币政策明确转向，流动性充裕，短端大幅下行，加上对未来市场预期达成一致，期限利差进一步压缩。由于前期落地监管政策并未出现放松，金融机构风险偏好一时间难以提升，宽货币政策传导不畅，资金链紧绷的企业信用违约风险爆发超预期，尤其是民企及部分区域城投，叠加股市萎靡，股权质押爆仓风险也浮出水面，金融机构风险偏好提升受阻，形成恶性循环，信用利差结构性分化非常明显，中高评级及国企信用利差压缩，民企、地产、部分区域城投信用利差仍维持高位。三季度一系列疏通宽信用的政策陆续出台，对宽信用起效的担忧，长端利率债出现窄幅震荡，但信用利差、期限利差进一步压缩，尤其是民企信用债需求好转，整体信用利差下降明显。年底经济金融数据延续下行趋势，宽信用政策效果证伪，债市又迎来一波大幅下行，绝对收益率、期限利差、信用利差均降至历史偏低位置。

### 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 3.9688%，本报告期兴全货币 B 类的基金份

额净值收益率为 4.2178%，同期业绩比较基准收益率为 1.3000%。

#### 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 2019 年，宽货币政策呵护下，流动性充裕，有效补充银行资本的各类工具不断出台，监管考核指标边际上有所放松，表外融资也有边际好转迹象，宽信用效果年初已经有所体现。地方债较往年提前发行，基建项目加速审批，积极财政政策拖底经济效果也可能很快见效。房地产政策一直未有放松迹象，在销售持续降温情况下，滞后的地产投资放缓在今年可能对经济的拖累较明显。海外主要经济体均在年初下修经济增长预期，货币政策预期均转向宽松，贸易摩擦预期改善但仍有不确定性，因此今年出口对经济的贡献不确定性仍较大。由于美国内部政见摩擦，以及美国经济显现放缓迹象，人民币贬值压力今年明显改善，对国内货币政策的制约较以往降低。猪瘟对今年整个食品价格的影响可能是今年通胀超预期的最大不确定性因素。在当前债市绝对收益率以及各类利差处于历史较低水平的情况下，宽货币宽信用政策也已经持续较长时间，经济金融数据可能会较快企稳，加上股市相对性价比更优，风险偏好的改善可能会提前，因此债市继续下行空间较小，在市场一致性预期过强的情况下，警惕转向时间超预期可能。

#### 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 A 类基金基金份额持有人分配利润 316,975,889.70 元，向 B 类基金基金份额持有人分配利润 734,439,085.40 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

本托管人依据《兴全货币市场证券投资基金基金合同》与《兴全货币市场证券投资基金托管协议》，自 2006 年 4 月 27 日起托管兴全货币市场证券投资基金（即更名后的“兴全货币市场证券投资基金”）（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；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

本报告期基金财务报告经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师(黄小熠)、(钱琛琛)签字出具了(标准无保留意见)(毕马威华振审字第 1900206 号)标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金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：兴全货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,076,680,774.97	10,783,844,914.41
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	15,340,991,611.78	11,498,851,981.65
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		15,340,991,611.78	11,498,851,981.65
资产支持证券投资		-	-
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	7,741,559,612.32	5,303,589,185.42
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	133,865,156.64	142,816,271.31
应收股利		-	-
应收申购款		88,186,739.78	87,883,012.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		30,381,283,895.49	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 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,645,390,571.89	3,807,912,692.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		399,868.55	2,451,810.18
应付管理人报酬		4,415,921.63	3,839,753.66
应付托管费		1,226,644.90	1,066,598.18
应付销售服务费		1,705,078.05	1,662,335.79
应付交易费用	7.4.7.7	481,791.59	305,845.19
应交税费		188,162.54	-
应付利息		2,350,198.51	2,603,223.92

应付利润		53,924,703.68	62,748,148.59
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	139,783.55	124,992.08
负债合计		3,710,222,724.89	3,882,715,399.59
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	26,671,061,170.60	23,934,269,965.49
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		26,671,061,170.60	23,934,269,965.49
负债和所有者权益总计		30,381,283,895.49	27,816,985,365.08

报告截止日 2018 年 12 月 31 日，兴全货币 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 6,872,870,200.14 份；兴全货币 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 19,798,190,970.46 份。兴全货币份额总额合计为 26,671,061,170.60 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,206,308,964.27	807,945,730.96
1.利息收入		1,188,254,050.95	805,357,908.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	451,739,587.35	382,160,039.90
债券利息收入		466,162,585.88	337,153,712.93
资产支持证券利息收入		-	45,954.60
买入返售金融资产收入		270,351,877.72	85,998,201.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,998,034.79	2,576,922.84
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	17,998,034.79	2,576,922.84
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	56,878.53	10,899.22

<b>减：二、费用</b>		154,893,989.17	102,003,740.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	46,815,035.28	32,860,680.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	13,004,176.63	9,335,734.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	22,042,970.53	16,004,867.21
4. 交易费用	7.4.7.19	1,249.75	430.25
5. 利息支出		72,552,852.35	43,509,923.94
其中：卖出回购金融资产支出		72,552,852.35	43,509,923.94
6. 税金及附加		228,541.07	-
7. 其他费用	7.4.7.20	249,163.56	292,104.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,051,414,975.10	705,941,990.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,051,414,975.10	705,941,990.13

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	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）	-	1,051,414,975.10	1,051,414,975.10
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）	2,736,791,205.11	-	2,736,791,205.11
其中：1. 基金申购款	66,312,629,628.46	-	66,312,629,628.46
2. 基金赎回款	-63,575,838,423.35	-	-63,575,838,423.35
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）	-	-1,051,414,975.10	-1,051,414,975.10
五、期末所有者权益（基金净值）	26,671,061,170.60	0.00	26,671,061,170.60
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	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）	-	705,941,990.13	705,941,990.13
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）	20,097,654,516.48	-	20,097,654,516.48
其中：1. 基金申购款	48,932,993,856.90	-	48,932,993,856.90
2. 基金赎回款	-28,835,339,340.42	-	-28,835,339,340.42
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）	-	-705,941,990.13	-705,941,990.13
五、期末所有者权益（基金净值）	23,934,269,965.49	0.00	23,934,269,965.49

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：

<u>          兰  荣          </u>	<u>          庄  园  芳          </u>	<u>          詹  鸿  飞          </u>
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》（证监基金字〔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》及其配套规则和《兴全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及注册登记机构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。

根据兴全货币市场证券投资基金基金份额持有人大会于2017年3月31日表决通过的《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》，自2017年3月31日起，

兴全基金管理有限公司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。本基金对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。

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，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行存款、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、短期融资券以及中国证监会、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。

#### **7.4.2 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。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度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**

本基金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。

#### **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**

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《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》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[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[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不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对自国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### 7.4.7 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”）	基金托管人、基金销售机构



银行” )	
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 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。

#### 7.4.8.1.2 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。

#### 7.4.8.1.3 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。

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 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。

### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	46,815,035.28	32,860,680.38
其中：支付销售机构的客户维护费	9,989,342.49	3,387,888.54

注：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×0.18%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	13,004,176.63	9,335,734.54

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。

#### 7.4.8.2.3 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 12 月 31 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
兴全基金管理有限公司	1,153,234.06	1,533,214.08	2,686,448.14
兴业证券	712,271.13	19,577.58	731,848.71
兴业银行	302,676.56	10,342.41	313,018.97
合计	2,168,181.75	1,563,134.07	3,731,315.82
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 12 月 31 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
兴全基金管理有限公司	7,322,936.35	1,076,925.99	8,399,862.34
兴业证券	390,018.05	1,074.49	391,092.54
兴业银行	216,965.62	674.79	217,640.41
合计	7,929,920.02	1,078,675.27	9,008,595.29

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

A 级份额：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

B 级份额：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数

对于由 B 类基金份额降级为 A 类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。对于由 A 类基金份额升级为 B 类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的销售服务费率。

## 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

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	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 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	98,938,500.00	-	499,700,000.00	2,266,447.53	4,870,020,000.00	575,025.98

#### 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 2018年1月1日至2018年12月31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	524,084.38	464,589,779.17
减：期间赎回/卖出总份额	-	1,017,158,648.98
期末持有的基金份额	524,084.38	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0020%	-

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

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。

##### 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

兴全货币A类

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31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
兴业银行	-	-	4,057,420.92	0.0170%

兴全货币B类

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31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	56,367,558.10	0.2113%	66,041,739.79	0.2759%
兴业银行	6,636,260,778.57	24.8819%	9,146,109,697.33	38.2134%
兴业证券	205,862,351.45	0.7719%	1,639,171,758.48	6.8486%

##### 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017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	26,680,774.97	9,243,960.24	3,844,914.41	23,258,457.52

#### 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。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2018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

本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

##### 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暂时停牌股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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人民币 3,645,390,571.89 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
111809325	18 浦发银行 CD325	2019 年 1 月 2 日	98.15	1,000,000	98,145,080.80
111809344	18 浦发银行 CD344	2019 年 1 月 2 日	98.07	1,000,000	98,071,680.69
111812111	18 北京银行 CD111	2019 年 1 月 2 日	98.80	1,000,000	98,798,392.19
111814246	18 江苏银行 CD246	2019 年 1 月 2 日	99.61	1,220,000	121,524,914.91
111814270	18 江苏银行 CD270	2019 年 1 月 2 日	99.49	3,000,000	298,470,294.80
111818289	18 华夏银行 CD289	2019 年 1 月 2 日	98.17	600,000	58,903,676.40
111821370	18 渤海银行 CD370	2019 年 1 月 2 日	99.43	1,900,000	188,914,742.98
111870280	18 重庆农村商业银行 CD179	2019 年 1 月 2 日	98.64	420,000	41,429,699.93

111871573	18 长沙银行 CD228	2019 年 1 月 2 日	98.28	2,000,000	196,566,020.60
111885352	18 厦门国际银行 CD220	2019 年 1 月 2 日	98.33	2,000,000	196,658,079.11
111892638	18 南京银行 CD033	2019 年 1 月 2 日	99.42	3,150,000	313,163,419.70
111899562	18 成都银行 CD165	2019 年 1 月 2 日	99.13	1,000,000	99,127,613.57
140303	14 进出 03	2019 年 1 月 2 日	100.20	130,000	13,026,096.34
140422	14 农发 22	2019 年 1 月 2 日	100.50	1,100,000	110,549,941.29
101460006	14 南通国投 MTN001	2019 年 1 月 3 日	101.31	100,000	10,131,150.83
101461007	14 建发集 MTN001	2019 年 1 月 3 日	101.48	500,000	50,740,869.43
111808265	18 中信银行 CD265	2019 年 1 月 3 日	98.08	490,000	48,059,549.08
111889929	18 宁波银行 CD244	2019 年 1 月 3 日	99.51	1,000,000	99,507,637.74
111897256	18 西安银行 CD025	2019 年 1 月 3 日	98.75	500,000	49,373,490.15
120401	12 农发 01	2019 年 1 月 3 日	100.16	1,000,000	100,156,221.81
140418	14 农发 18	2019 年 1 月 3 日	100.47	1,400,000	140,658,892.16
160208	16 国开 08	2019 年 1 月 3 日	100.01	2,000,000	200,018,927.99
160415	16 农发 15	2019 年 1 月 3 日	100.04	2,700,000	270,100,355.84
180305	18 进出 05	2019 年 1 月 3 日	100.24	1,000,000	100,235,166.51
111815448	18 民生银行 CD448	2019 年 1 月 4 日	98.34	1,000,000	98,343,708.51
111884102	18 徽商银行 CD119	2019 年 1 月 4 日	99.41	100,000	9,941,001.64
140303	14 进出 03	2019 年 1 月 4 日	100.20	100,000	10,020,074.11
140312	14 进出 12	2019 年 1 月 4 日	100.12	500,000	50,058,572.67
140418	14 农发 18	2019 年 1 月 4 日	100.47	100,000	10,047,063.73
160208	16 国开 08	2019 年 1 月 4 日	100.01	900,000	90,008,517.60

		日			
180201	18 国开 01	2019 年 1 月 4 日	100.11	500,000	50,054,210.60
180207	18 国开 07	2019 年 1 月 4 日	100.26	1,000,000	100,256,009.15
180301	18 进出 01	2019 年 1 月 4 日	100.04	100,000	10,003,700.90
180305	18 进出 05	2019 年 1 月 4 日	100.24	300,000	30,070,549.95
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 4 日	100.25	500,000	50,126,894.00
111821355	18 渤海银行 CD355	2019 年 1 月 7 日	99.50	2,050,000	203,984,523.49
111808265	18 中信银行 CD265	2019 年 1 月 9 日	98.08	510,000	50,021,163.33
合计				37,870,000	3,765,267,904.53

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场正回购抵押债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2018 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人民币 15,340,991,611.78 元，无属于第一、三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第二层次的余额为人民币 11,498,851,981.65 元，无属于第一、三层次的余额）。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2017 年 12 月 31 日：无)。

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。



## § 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	15,340,991,611.78	50.49
	其中:债券	15,340,991,611.78	50.49
2	买入返售金融资产	7,741,559,612.32	25.48
3	银行存款和结算备付金合计	7,076,680,774.97	23.29
4	其他各项资产	222,051,896.42	0.73
5	合计	30,381,283,895.49	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	10.13	
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	3,645,390,571.89	13.67

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。

### 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	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违规超过 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	28.60	13.67
2	30 天(含)—60 天	20.84	-
3	60 天(含)—90 天	25.29	-
4	90 天(含)—120 天	10.21	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	28.14	-
	合计	113.08	13.67

**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期限未发生违规超过 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 (%)
3	金融债券	1,352,425,320.63	5.07
	其中：政策性金融债	1,352,425,320.63	5.07
5	企业短期融资券	1,314,276,791.06	4.93
6	中期票据	353,979,562.39	1.33
7	同业存单	12,320,309,937.70	46.19
9	合计	15,340,991,611.78	57.52

**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	111809297	18 浦发银行 CD297	6,000,000	594,612,731.90	2.23
2	111821347	18 渤海银行 CD347	5,000,000	497,554,977.63	1.87
3	111814270	18 江苏银行 CD270	5,000,000	497,450,491.33	1.87
4	111805181	18 建设银行 CD181	5,000,000	497,336,359.52	1.86
4	111803138	18 农业银行 CD138	5,000,000	497,336,359.52	1.86
4	111804036	18 中国银行 CD036	5,000,000	497,336,359.52	1.86
5	111892638	18 南京银	5,000,000	497,084,793.18	1.86

		行 CD033			
6	111821138	18 渤海银行 CD138	5,000,000	494,754,080.78	1.86
7	111897913	18 重庆农村商业银行 CD042	4,000,000	397,790,047.45	1.49
8	111821335	18 渤海银行 CD335	4,000,000	395,333,109.61	1.48
9	111811206	18 平安银行 CD206	4,000,000	391,635,162.84	1.47
10	111882322	18 杭州银行 CD061	3,500,000	343,545,681.43	1.29

### 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
报告期内偏离度的最高值	0.2253%
报告期内偏离度的最低值	0.0025%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0884%

#### 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。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

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受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内无需说明的证券投资决策程序，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。

### 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
3	应收利息	133,865,156.64
4	应收申购款	88,186,739.78
8	合计	222,051,896.42

### 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

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	464,041	14,810.91	167,041,215.05	2.43%	6,705,828,985.09	97.57%
兴全货币B类	301	65,774,720.83	19,089,317,305.64	96.42%	708,873,664.82	3.58%
合计	464,342	57,438.40	19,256,358,520.69	72.20%	7,414,702,649.91	27.80%

### 9.2 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	2,635,916,763.77	9.88%
2	基金类机构	995,000,000.00	3.74%
3	银行类机构	829,474,232.93	3.12%
4	银行类机构	500,172,007.40	1.88%
5	银行类机构	500,172,007.40	1.88%
6	银行类机构	500,000,000.00	1.87%
7	银行类机构	500,000,000.00	1.87%
8	银行类机构	500,000,000.00	1.87%
9	银行类机构	500,000,000.00	1.87%
10	银行类机构	500,000,000.00	1.87%

### 9.3 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	12,767,916.46	0.1858%
	合计	12,767,916.46	0.0479%

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）。

### 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

## § 10 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
本报告期期间基金总申购份额	27,297,385,922.00	39,015,243,706.46
减:本报告期期间基金总赎回份额	27,056,588,817.87	36,519,249,605.48
本报告期期末基金份额总额	6,872,870,200.14	19,798,190,970.46

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。

## § 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。

- 1) 2018 年 3 月 21 日公告, 自 2018 年 3 月 21 日起, 傅鹏博先生离任公司副总经理。
- 2) 2018 年 5 月 11 日公告, 自 2018 年 5 月 11 日起, 陈锦泉先生担任公司副总经理。
- 3) 2018 年 6 月 13 日公告, 自 2018 年 6 月 12 日起, 杨卫东先生担任公司督察长, 离任公司副总经理; 冯晓莲女士离任公司督察长。

(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 2015 年起连续 4 年聘请毕马威华振会计师事务所(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 6.0 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	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。



**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	-	-	-	-	-	-

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。

**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

### 12.1 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	2018-1-2 至 2018-11-29	9,146,109,697.33	789,807,066.44	7,300,000,000.00	2,635,916,763.77	9.88 %
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等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。

3、该投资者持有份额为兴全货币 B，分级基金按总份额占比计算。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴全基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日