

# 兴全货币市场证券投资基金 2018 年年度报告

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。

## 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.....	3
<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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 债券回购融资情况.....	55
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	55
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.....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56

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 .....	57
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	57
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 .....	58
8.9 投资组合报告附注 .....	58
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	63
11.9 其他重大事件 .....	63
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 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	26,671,061,170.60 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
下属分级基金的场内简称:	-	-
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	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
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		201204	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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、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
	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
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末 指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末
	累计	49.8507%	7.7551%	44.1305%	3.3942%

净值 收益 率					
---------------	--	--	--	--	--

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

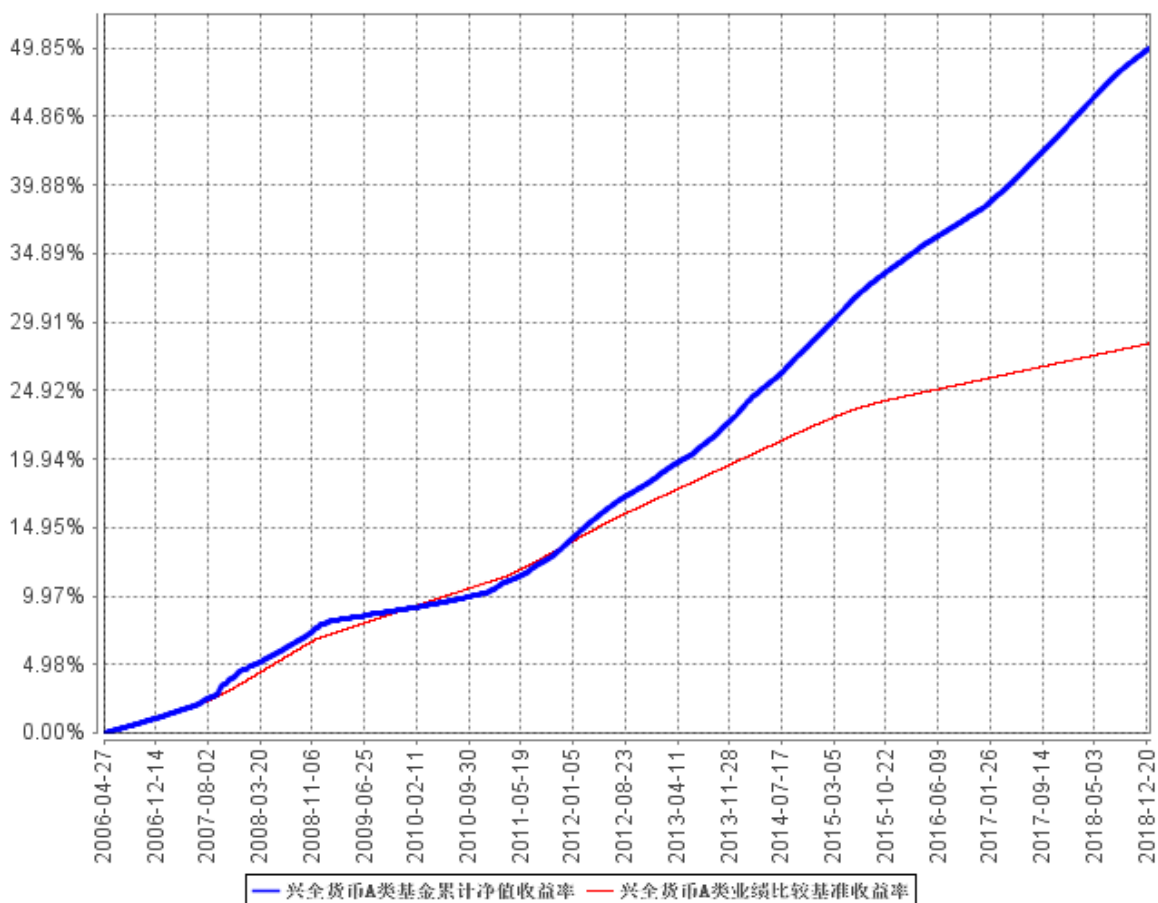
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.8421%	0.0016%	0.3277%	0.0000%	0.5144%	0.0016%
过去六个月	1.8378%	0.0026%	0.6553%	0.0000%	1.1825%	0.0026%
过去一年	4.2178%	0.0026%	1.3000%	0.0000%	2.9178%	0.0026%
自基金合同 生效起至今	7.7551%	0.0021%	2.2652%	0.0000%	5.4899%	0.0021%

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。

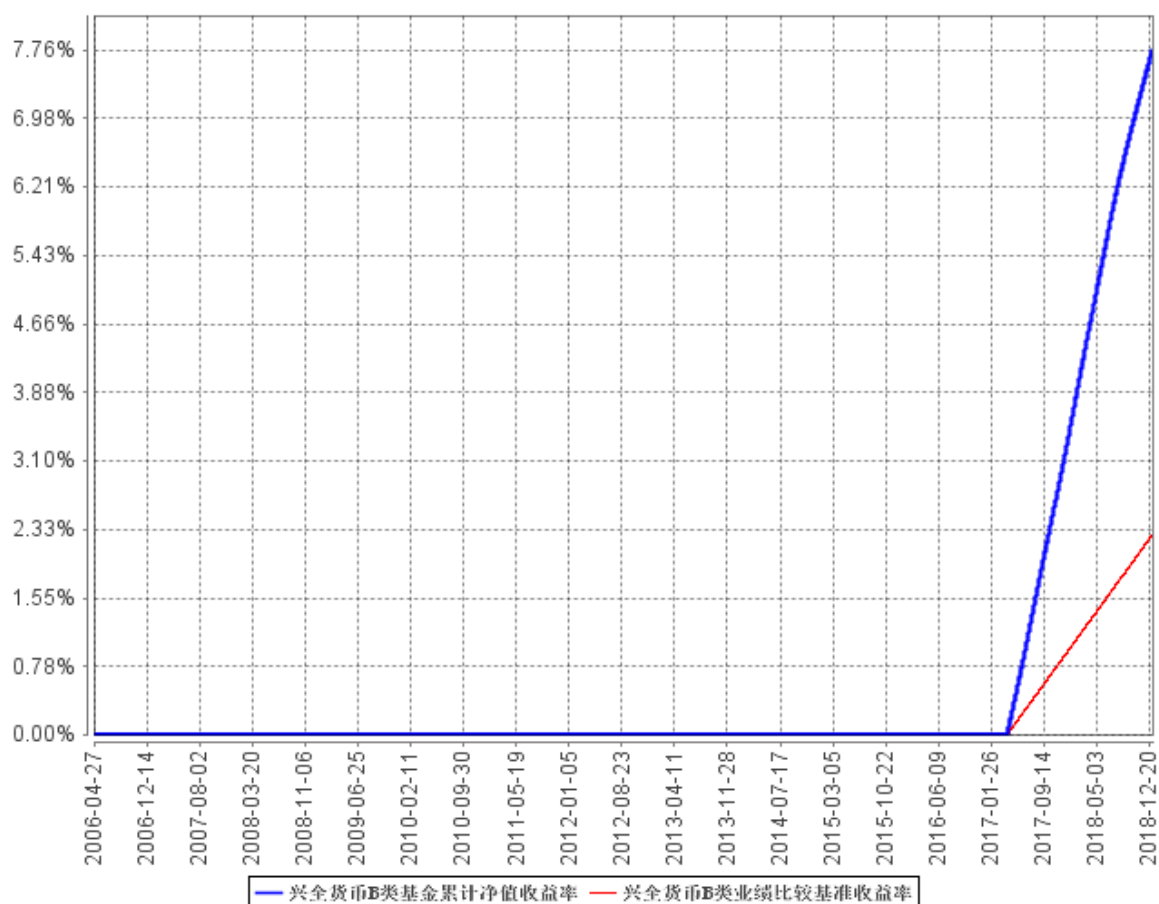


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

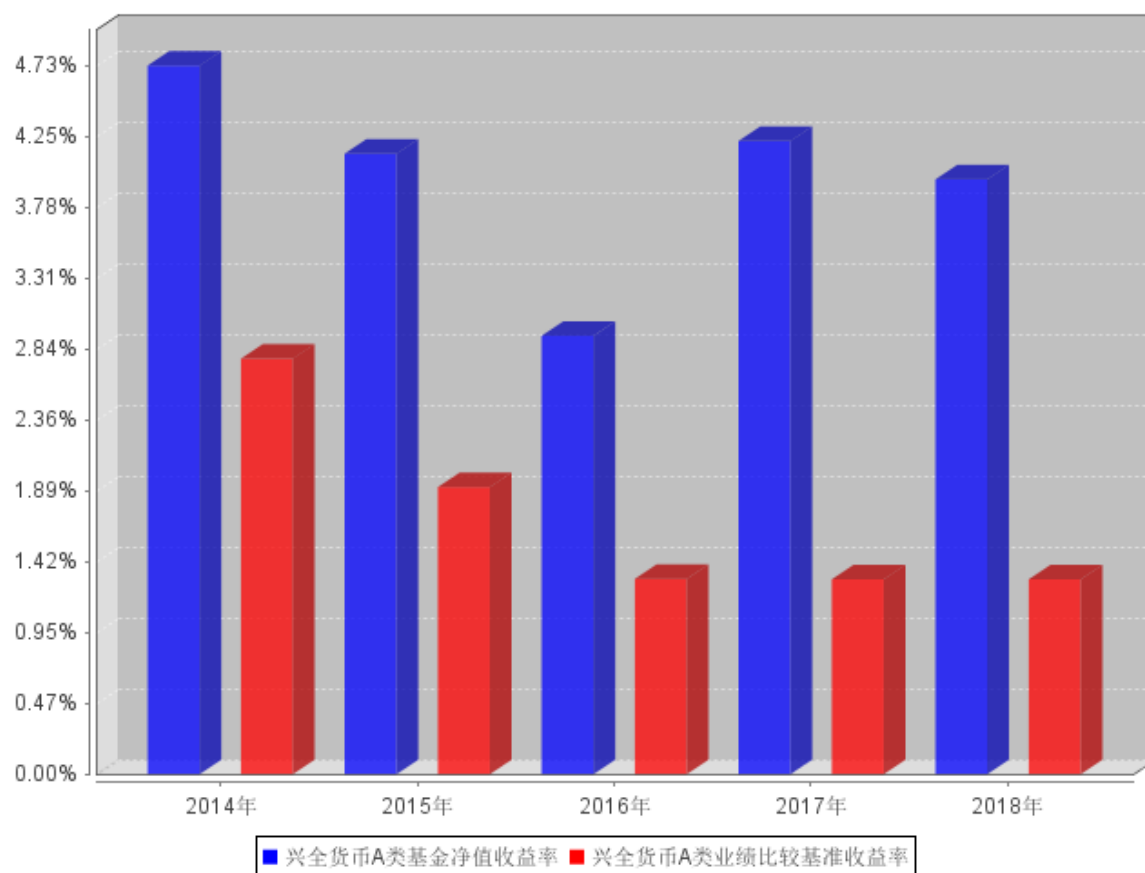


注：1、净值表现所取数据截至到 2018 年 12 月 31 日。

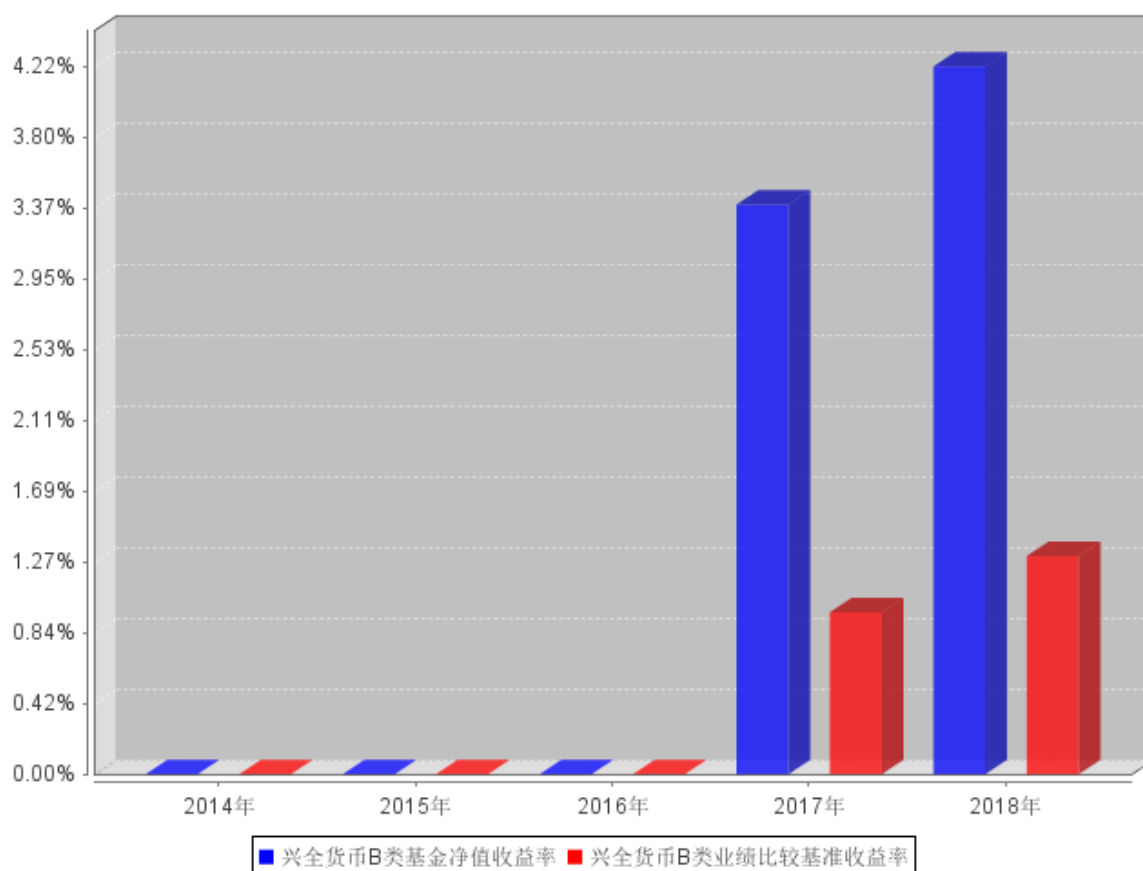
2、按照《兴全货币市场证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2006 年 4 月 27 日至 2006 年 10 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 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 其他指标

无。

### 3.4 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，积极财政政策托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，公司风险管理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，公司风险管理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）明确交易部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。

#### 4.9 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

### 6.1 审计报告基本信息

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	毕马威华振审字第 1900206 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的第 1 页至第 37 页的兴全货币市场证券投资基金（以下简称“兴全货币基金”）财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了兴全货币基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴全货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司对其他信息负责。其他信息包括兴全货币基金 2018 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投

	<p>资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司管理层负责评估兴全货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非兴全货币基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司治理层负责监督兴全货币基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对兴全货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不</p>

	<p>确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致兴全货币基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与兴全货币基金经理人兴全基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王国蓓   钱琛琛
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## § 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



减：二、费用		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
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,051,414,975.10	705,941,990.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可

供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资

产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 损益平准金

-

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

“每日分配、按月支付”。本基金的基金份额采用人民币 1.00 元的固定份额净值交易方式，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，并按月结转到投资者基金账户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元；基金投资当期亏损时，相应调减持有人持有份额，基金份额净值始终为 1.00 元。本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配到投资者收益账户。每月累计收益只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式结转为基金份额，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将缩减投资者基金份额。若投资者赎回时，收益为负值，则

将从投资者赎回基金款中扣除。本基金合同生效后，每月集中结转当前累计收益，合同生效不满一个月不结转。本基金收益结转时以截尾的方式保留小数点后两位。因截尾形成的余额归入基金财产，参与第二个工作日的分配。每一基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额不享有当日分红权益；当日赎回的基金份额享有当日分红权益。在符合相关法律、法规及规范性文件的规定，并且不影响投资者利益情况下，经与基金托管人协商一致并得到批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。

### **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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	26,680,774.97	3,844,914.41
定期存款	7,050,000,000.00	10,780,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	400,000,000.00	500,000,000.00
存款期限 1-3 个月	950,000,000.00	1,920,000,000.00
存款期限 3 个月以上	5,700,000,000.00	8,360,000,000.00



其他存款	-	-
合计:	7,076,680,774.97	10,783,844,914.41

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018年12月31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	15,340,991,611.78	15,360,180,000.00	19,188,388.22	0.0719%
	合计	15,340,991,611.78	15,360,180,000.00	19,188,388.22	0.0719%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		15,340,991,611.78	15,360,180,000.00	19,188,388.22	0.0719%
项目		上年度末 2017年12月31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	11,498,851,981.65	11,484,835,000.00	-14,016,981.65	-0.0586%
	合计	11,498,851,981.65	11,484,835,000.00	-14,016,981.65	-0.0586%
资产支持证券		-	-	-	-
合计		11,498,851,981.65	11,484,835,000.00	-14,016,981.65	-0.0586%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	7,741,559,612.32	-
合计	7,741,559,612.32	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券_银行间	5,303,589,185.42	-
合计	5,303,589,185.42	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	32,006.94	8,384.41
应收定期存款利息	31,359,749.37	51,935,930.54
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	80,023,876.72	78,517,898.63
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	22,447,201.48	12,279,078.79
应收申购款利息	2,322.13	74,978.94
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	133,865,156.64	142,816,271.31

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	481,791.59	305,845.19
合计	481,791.59	305,845.19

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	783.55	992.08
预提费用	-	-
应付转换费	-	-
审计师费	60,000.00	45,000.00
账户服务费	4,500.00	4,500.00
上清所账户服务费	4,500.00	4,500.00
信息披露费	70,000.00	70,000.00
合计	139,783.55	124,992.08

#### 7.4.7.9 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12月31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	27,297,385,922.00	27,297,385,922.00
本期赎回(以“-”号填列)	-27,056,588,817.87	-27,056,588,817.87
- 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	6,872,870,200.14	6,872,870,200.14

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12月31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	39,015,243,706.46	39,015,243,706.46
本期赎回(以“-”号填列)	-36,519,249,605.48	-36,519,249,605.48
- 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	19,798,190,970.46	19,798,190,970.46

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	316,975,889.70	-	316,975,889.70
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	-316,975,889.70	-	-316,975,889.70
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	734,439,085.40	-	734,439,085.40
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	-734,439,085.40	-	-734,439,085.40
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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

活期存款利息收入	331,460.24	178,388.13
定期存款利息收入	451,007,613.28	381,852,902.56
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	60.00	6,467.67
其他	400,453.83	122,281.54
合计	451,739,587.35	382,160,039.90

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未进行股票买卖交易。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31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	17,998,034.79	2,576,922.84
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	17,998,034.79	2,576,922.84

##### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	87,792,232,914.90	40,117,487,698.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	87,246,414,772.98	39,899,198,440.96
减：应收利息总额	527,820,107.13	215,712,334.29
买卖债券差价收入	17,998,034.79	2,576,922.84

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

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
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出资产支持证券成交总额	-	15,706,577.64
减：卖出资产支持证券成本总额	-	15,670,000.00
减：应收利息总额	-	36,577.64
资产支持证券投资收益	-	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期末及上年度末均不存在公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	56,878.53	10,899.22
合计	56,878.53	10,899.22

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	1,249.75	430.25
交易基金产生的费用	-	-

其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,249.75	430.25

#### 7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	60,000.00	45,000.00
信息披露费	70,000.00	70,000.00
其他	719.56	51,325.00
银行汇划费	-	-
交易费用	-	-
账户服务费	36,300.00	36,500.00
银行费用	82,144.00	89,279.51
合计	249,163.56	292,104.51

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 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=前一日基金资产净值×0.18%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 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=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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。

## 7.4.10.3 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 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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 12 月 31 日	
	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）持有的基金份额	-	-
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
期间因拆分变动份额	-	-
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%	-

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	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）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	46,271,983.05	-
期间申购/买入总份额	-	573,568,869.81
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	46,271,983.05	21,000,000.00
期末持有的基金份额	-	552,568,869.81
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.3087%

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。

##### 7.4.10.4.2 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%

#### 7.4.10.5 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		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

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 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
302,220,808.18	20,567,299.59	-5,812,218.07	316,975,889.70	-

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
711,564,039.10	25,886,273.14	-3,011,226.84	734,439,085.40	-

#### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 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	2019 年 1 月 2	99.42	3,150,000	313,163,419.70

	行 CD033	日			
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
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

		日			
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

#### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负责，并向首席执行官汇报日常行政事务。

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、相关职能和业务部门构成的风险管理架构体系。

### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	342,802,178.51	210,546,238.81
A-1 以下	0.00	-
未评级	971,474,612.55	1,663,479,021.06
合计	1,314,276,791.06	1,874,025,250.87

注：未评级债券为超短期融资券等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 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按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 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按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	343,848,411.56	-
AAA 以下	10,131,150.83	80,513,873.20
未评级	0.00	-
合计	353,979,562.39	80,513,873.20

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。



#### 7.4.13.2.5 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按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 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 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	11,827,828,164.29	-
AAA 以下	492,481,773.41	-
未评级	0.00	-
合计	12,320,309,937.70	-

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年 12月	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
---------------------	-------	-------	--------	----------	--------------	-----	----

31 日					上		
资产							
银行存款	826,680,774.97	2,650,000,000.00	3,600,000,000.00	-	-	-	7,076,680,774.97
交易性金融资产	410,404,857.70	8,322,203,520.48	6,608,383,233.60	-	-	-	15,340,991,611.78
买入返售金融资产	6,390,223,265.32	1,351,336,347.00	-	-	-	-	7,741,559,612.32
应收利息	-	-	-	-	-	133,865,156.64	133,865,156.64
应收申购款	14,303,180.20	-	-	-	-	73,883,559.58	88,186,739.78
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,641,612,078.19	12,323,539,867.48	10,208,383,233.60	-	-	207,748,716.22	30,381,283,895.49
负债							
卖出回购金融资产款	3,645,390,571.89	-	-	-	-	-	3,645,390,571.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	399,868.55	399,868.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,415,921.63	4,415,921.63
应付托管费	-	-	-	-	-	1,226,644.90	1,226,644.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,705,078.05	1,705,078.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	481,791.59	481,791.59
应付利息	-	-	-	-	-	2,350,198.51	2,350,198.51
应交税费	-	-	-	-	-	188,162.54	188,162.54
应付利润	-	-	-	-	-	53,924,703.68	53,924,703.68
其他负债	-	-	-	-	-	139,783.55	139,783.55
负债总计	3,645,390,571.89	-	-	-	-	64,832,153.00	3,710,222,724.89

利率敏 感度缺 口	3,996,221,506.30	12,323,539,867.48	10,208,383,233.60	-	-	-142,916,563.22	26,671,061,170.60
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	-	-	-	-	-	124,992.08	124,992.08

债							
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

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 1%	43,562,343.55	38,649,366.78
	市场利率上升 1%	-43,242,150.62	-38,308,406.11

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。	
假设	1. 置信区间 -
	2. 观察期 -

分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2018 年 12 月 31 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
----	--------------------	------------------------	-------------------------

#### 7.4.14 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
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,741,559,612.32	25.48
	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	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	
	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	3,645,390,571.89	13.67
	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。

### 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
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	25.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	28.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	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 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
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
4	企业债券	-	-
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
8	其他	-	-
9	合计	15,340,991,611.78	57.52



10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

### 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 南京银行 CD033	5,000,000	497,084,793.18	1.86
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	0.2253%
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
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	133,865,156.64
4	应收申购款	88,186,739.78
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
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%
	兴全货币 B 类	-	-
	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

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

## § 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
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	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%。

**11.9 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》和公司网站	2018 年 1 月 1 日
2	关于长期停牌股票（万华化学）估值方法调整的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 1 月 6 日
3	关于设立上海分公司的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 1 月 10 日
4	关于旗下基金参加华鑫证券定投及申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 1 月 25 日
5	关于旗下基金参加德邦证券定投及申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 1 月 29 日
6	关于旗下基金参加中泰证券定投及申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 1 月 30 日
7	关于旗下基金参加海通证券定投及申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 1 月 30 日
8	关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 2 月 7 日
9	关于长期停牌股票（康得新和光环新网）估值方法调整的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 2 月 8 日
10	关于调整旗下基金在兴业证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 3 月 5 日
11	关于解聘副总经理的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 3 月 21 日
12	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》和公司网站	2018 年 3 月 23 日
13	关于旗下部分基金将收取短期赎回费的提示性公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 3 月 23 日

14	关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年3月28日
15	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年3月30日
16	关于调整部分旗下基金在中国银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年4月12日
17	关于调整部分旗下基金在华夏银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年4月12日
18	关于调整部分旗下基金在银河证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年4月13日
19	关于调整部分旗下基金在东海证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年4月13日
20	关于增加中国中投证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年4月19日
21	关于旗下基金所持证券（中兴通讯）调整估值价的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年4月19日
22	关于增聘副总经理的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年5月11日
23	关于网上直销开通“汇收付”业务的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年5月16日
24	关于调整旗下基金在国泰君安证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年5月28日
25	关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年6月13日
26	关于旗下基金所持证券（中兴通讯）调整估值价的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年6月14日
27	关于长期停牌股票（康得新）估值方法调整的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年6月20日
28	关于长期停牌股票（天齐锂业）估值方法调整的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年6月21日
29	关于调整网上直销基金转换、赎回申购优惠费率公告	《中国证券报》和公司网站	2018年6月23日
30	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠和暂停网上银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年6月30日
31	旗下各基金 2018 年 6 月 30 日资产净值公告	《中国证券报》和公司网站	2018年7月2日
32	关于调整部分旗下基金在招商证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年7月13日



33	关于调整部分旗下基金在工商银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年7月23日
34	关于长期停牌股票（隆平高科）估值方法调整的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年8月18日
35	关于旗下部分基金参与中国工商银行“工银理财节”费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年8月24日
36	关于增加江苏银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年9月5日
37	关于旗下基金在九州证券开通定投业务及参加申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年9月17日
38	关于调整网上直销部分基金转换、赎回转购优惠费率的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年9月20日
39	兴全基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年9月29日
40	兴全基金管理有限公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年9月29日
41	关于长期停牌股票（奥马电器）估值方法调整的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年10月20日
42	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下基金销售机构的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年10月29日
43	兴全基金管理有限公司关于调整旗下部分基金转换补差费计算方式的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年11月28日
44	关于调整旗下部分基金在国信证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年12月13日
45	关于调整旗下部分基金在广发证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年12月14日
46	关于调整网上直销部分基金转换、赎回转购优惠费率的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年12月20日
47	兴全基金管理有限公司关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年12月26日
48	兴全基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大银行费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018年12月26日
49	兴全基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行开放	《中国证券报》和公司网站	2018年12月26日

	式基金交易费率优惠活动的公告		
50	兴全基金管理有限公司参加中国工商银行 2019 倾心回馈基金定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 12 月 26 日
51	关于调整旗下部分基金在华福证券费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	2018 年 12 月 28 日

## § 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xyfunds.com.cn>) 查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

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

2019年3月28日