

# 兴全添利宝货币市场基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 3 月 25 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 2020 年 3 月 23 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 2019 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>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 债券回购融资情况.....	52
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	52
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.....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	54

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	55
8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 .....	55
8.9 投资组合报告附注 .....	55
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	61
11.9 其他重大事件 .....	61
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</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 .....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	64
13.3 查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全添利宝货币市场基金
基金简称	兴全添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	000575
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 27 日
基金管理人	兴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	87,485,785,640.04 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	根据宏观形势、利率走势等因素，确定各个阶段的投资组合平均久期、剩余期限等指标，并在这些指标要求的基础上构建投资组合；进行主动投资，有效提高资产组合收益。本基金综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合

	型基金及股票型基金
--	-----------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴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	gongxiaowu@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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		201204	200041
法定代表人		兰荣	高建平

注：2020 年 3 月 18 日起，基金管理人名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路 222 号 30 楼
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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	1,932,929,185.78	2,131,197,525.07	1,903,068,979.12
本期利润	1,932,929,185.78	2,131,197,525.07	1,907,568,979.12
本期净值收益率	2.7770%	3.9054%	3.9126%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末基金资产净值	87,485,785,640.04	46,034,278,763.80	44,286,142,939.31
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
累计净值收益率	23.9455%	20.5966%	16.0638%

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。

2、本基金收益分配按日结转份额。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6761%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.3358%	0.0008%
过去六个月	1.3405%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	0.6600%	0.0008%
过去一年	2.7770%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	1.4270%	0.0009%
过去三年	10.9692%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	6.9192%	0.0019%
过去五年	18.8105%	0.0022%	6.7537%	0.0000%	12.0568%	0.0022%
自基金合同 生效起至今	23.9455%	0.0026%	7.8929%	0.0000%	16.0526%	0.0026%

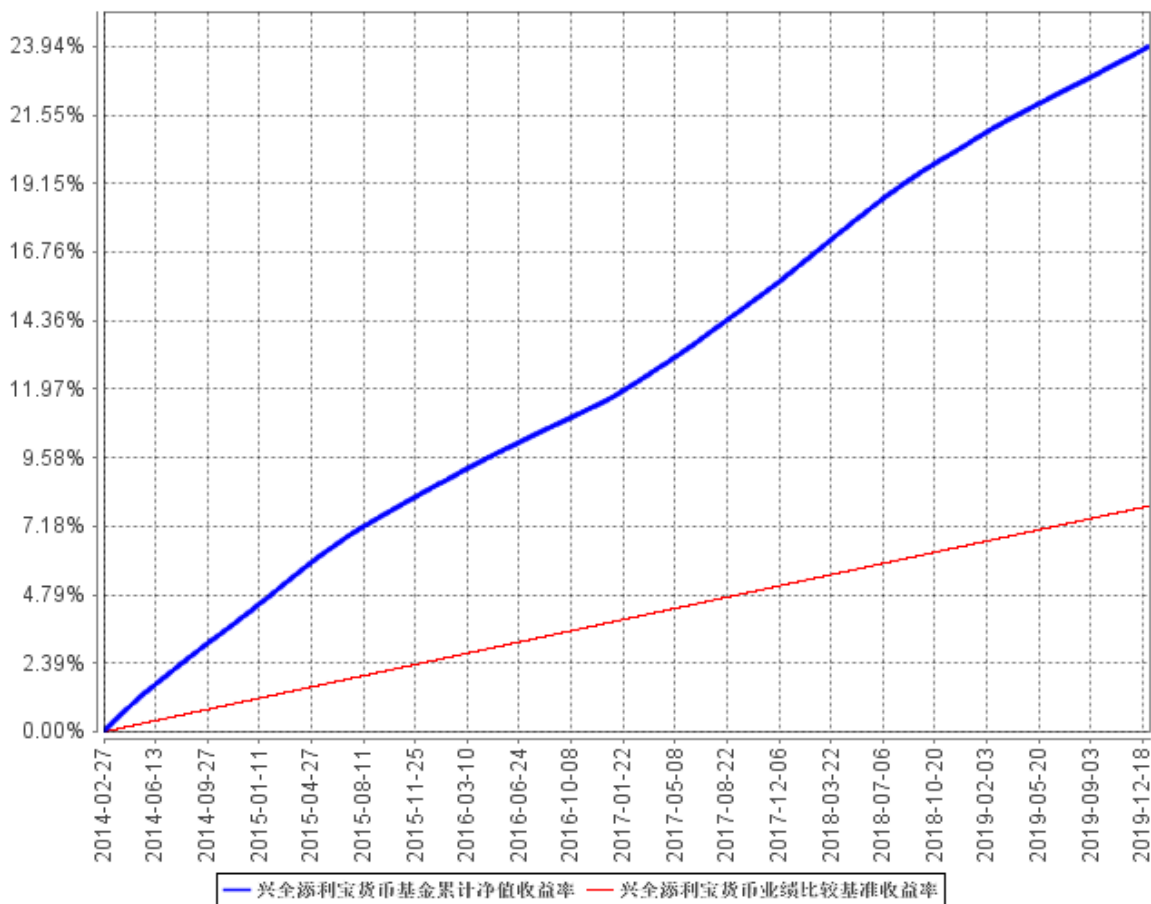
注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴全基



金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

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

兴全添利宝货币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

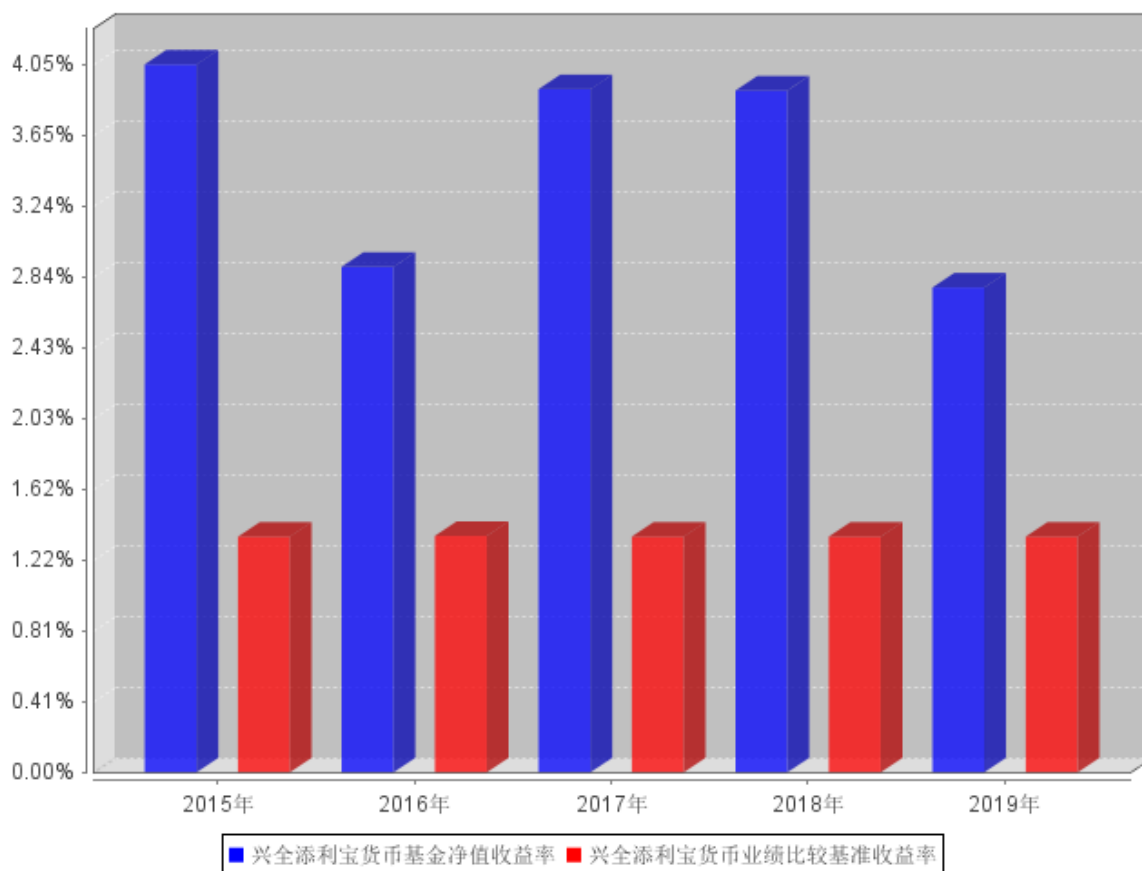


注：1、净值表现所取数据截至到 2019 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2014 年 2 月 27 日至 2014 年 5 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 3.2.3 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

兴全添利宝货币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



### 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

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
2019	1,932,929,185.78	-	-	1,932,929,185.78	
2018	2,131,197,525.07	-	-	2,131,197,525.07	
2017	1,907,568,979.12	-	-	1,907,568,979.12	
合计	5,971,695,689.97	-	-	5,971,695,689.97	

## § 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”。

截至2019年12月31日，公司旗下已管理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、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金及兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金共28只基金。

#### 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		
翟秀华	固定收益部总监助理	2016年3月17日	-	9年	医学硕士，历任毕马威华振会计师事

	理、本基金、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、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理				务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴全基金管理有限公司研究员兼基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
邓娟	本基金、兴全货币市场基金基金经理	2019 年 6 月 26 日	-	4 年	硕士。历任兴全基金管理有限公司固定收益部研究员、交易员，兴全添利宝货币市场基金基金经理助理、兴全天添益货币市场基金基金经理助理和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理助理。
邓娟	本基金、兴全天添益货币市	2018 年 8 月 27 日	2019 年 6 月 18 日	4 年	硕士。历任兴全基金管理有限公司固定收益部研究员、

	场基金和 兴全磐稳 增利债券 型证券投 资基金基 金经理助 理。				交易员。
--	--	--	--	--	------

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、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。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

2019 年，国内经济缓慢下行，增长压力加大，中美贸易摩擦反复，全球经济增长不确定性增加，在此背景下，国内政策定力十足，坚持国内经济由高速度向高质量增长思路。在“稳杠杆、稳增长、重质量”的思路指引下，基建托而不举，地产坚持“房住不炒”，财政政策侧重于减税降费，扩大内需，着力提质增效。货币政策在整体保持合理充裕的基础上，不再走“大水漫灌”的老路，强调逆周期调节，着力于疏通货币传导机制，降低实体经济融资成本。期间，金融供给侧改革持续推进，加剧市场对中小金融机构的经营担忧，央行重点防范金融系统性风险，四季度，虽有食品价格上涨引发的结构性通胀，但央行仍有意维持跨年资金面的稳定，减少了资金和短端资产价格的波动。

运作期内，在经济弱，货币政策宽松的背景下，货币市场的资产收益继续震荡下行，期限利差和信用利差持续压缩，货币基金收益的继续下行。整体上，本基金在保持账户流动性充裕的基础上，灵活使用杠杆和久期，为持有人带来了超越基准的投资收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 2.7770%，业绩比较基准收益率为 1.3500%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年 4 季度，国内经济虽仍运行在较弱的区间，但弱复苏迹象初现，中美贸易谈判取得实质进展，双方达成第一阶段协议，有利于降低全球经济的不确定性。2020 年是全面建设小康社会的关键之年，然而 2020 年初，超预期的肺炎疫情可能对国内经济的复苏造成冲击，在疫情的影响下，国内复工和消费等将受到较大影响，结构性通胀虽仍在，但短期内，货币政策可能继续维持宽松，并进一步疏通实体经济融资渠道，降低实体经济尤其是中小企业融资成本。为实现全面小康的目标，“稳增长，重质量”的政策组合预期持续推进，展望未来，疫情结束后，政策效果显现，经济企稳回升的可能性较大。整体看，债券市场的收益率已经处于历史低位，但上半年在疫情和宽松货币政策的背景下，债市尚不悲观，但需要降低收益预期，下半年，风险偏好可能回升，债券市场存在一定的调整压力。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本基金

自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按日结转到份额持有人的基金账户。本报告期内，本基金本报告期内向基金份额持有人分配利润 1,932,929,185.78 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

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	德师报(审)字(20)第 P00671 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	兴全添利宝货币市场基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了兴全添利宝货币市场基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全添利宝货币市场基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</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，我们独立于兴全添利宝货币市场基金，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	—
其他事项	—
其他信息	<p>兴全基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全添利宝货币市场基金 2019 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	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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</p>

	<p>表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估兴全添利宝货币市场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,除非基金管理人管理层计划清算兴全添利宝货币市场基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全添利宝货币市场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,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) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人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,就可能对兴全添利宝货币市场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</p>

	<p>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添利宝货币市场基金不能持续经营。</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>我们与基金管理人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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	侯雯
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2020 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	37,332,378,557.29	15,277,757,138.80
结算备付金		95,008,582.49	29,273,638.24
存出保证金		108,401.16	42,981.37
交易性金融资产	7.4.7.2	38,101,398,777.31	27,168,934,200.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		38,101,398,777.31	27,168,934,200.58
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	17,628,578,065.44	10,617,129,489.67
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	356,448,076.71	280,204,945.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		93,513,920,460.40	53,373,342,393.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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		4,524,252,592.77	4,835,739,066.36
应付证券清算款		1,459,700,000.00	2,474,094,041.11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,931,055.29	11,232,406.66
应付托管费		3,690,936.17	2,080,075.31
应付销售服务费		18,454,680.85	10,400,376.54
应付交易费用	7.4.7.7	857,544.38	800,513.52
应交税费		65,157.39	308,705.76
应付利息		893,853.51	4,113,444.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	289,000.00	295,000.00
负债合计		6,028,134,820.36	7,339,063,630.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	87,485,785,640.04	46,034,278,763.80
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		87,485,785,640.04	46,034,278,763.80
负债和所有者权益总计		93,513,920,460.40	53,373,342,393.86

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 87,485,785,640.04 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至	2018 年 1 月 1 日至

		2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,489,242,568.23	2,569,766,689.10
1. 利息收入		2,646,097,421.24	2,669,280,891.73
其中：存款利息收入	7.4.7.11	819,850,301.11	782,019,891.08
债券利息收入		1,350,839,370.90	1,364,058,680.76
资产支持证券利息收入		-	188,897.12
买入返售金融资产收入		475,407,749.23	523,013,422.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-156,854,853.01	-99,828,421.58
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	-156,854,853.01	-99,834,854.87
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	6,433.29
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	-	314,218.95
<b>减：二、费用</b>		556,313,382.45	438,569,164.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	191,777,722.69	149,629,065.64
2. 托管费	7.4.10.2.2	35,514,393.05	27,709,086.17
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	177,571,965.45	138,545,431.19
4. 交易费用	7.4.7.19	574.00	2,743.31
5. 利息支出		150,682,704.43	121,339,186.17
其中：卖出回购金融资产支出		150,682,704.43	121,339,186.17
6. 税金及附加		344,137.83	866,616.55

7. 其他费用	7.4.7.20	421,885.00	477,035.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,932,929,185.78	2,131,197,525.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,932,929,185.78	2,131,197,525.07

注：本基金合同于 2014 年 2 月 27 日生效，本期数据按实际存续期计算。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	46,034,278,763.80	-	46,034,278,763.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,932,929,185.78	1,932,929,185.78
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）	41,451,506,876.24	-	41,451,506,876.24
其中：1. 基金申购款	710,991,610,011.25	-	710,991,610,011.25
2. 基金赎回款	-669,540,103,135.01	-	-669,540,103,135.01
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	-	-1,932,929,185.78	-1,932,929,185.78



以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	87,485,785,640.04	-	87,485,785,640.04
项目	上年度可比期间 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)	44,286,142,939.31	-	44,286,142,939.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,131,197,525.07	2,131,197,525.07
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)	1,748,135,824.49	-	1,748,135,824.49
其中：1.基金申购款	277,254,446,486.39	-	277,254,446,486.39
2.基金赎回款	-275,506,310,661.90	-	-275,506,310,661.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-2,131,197,525.07	-2,131,197,525.07
五、期末所有者权益(基金净值)	46,034,278,763.80	-	46,034,278,763.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
兰荣  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
庄园芳  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
詹鸿飞  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全添利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴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》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2014]217 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 1,306,102,190.00 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(14)第 0174 号验资报告。基金合同于 2014 年 2 月 27 日正式生效。本基金的管理人为兴全基金管理有限公司,托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资范围为以下金融工具:现金、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款(包括活期存款、定期存款、通知存款等)、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、短期融资券、中期票据、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同期七天通知存款利率(税后)。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产分类为交易性金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，在初始确认时以公允价值计量。

#### 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

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含付息债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (2) 回购协议

基金持有的回购协议，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。相关金融资产或负债在回购日按账面余额结转。

本基金对所持有的债券投资和其他金融负债均以摊余成本法进行后续计量。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当收取金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资

产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法估算公允价值。估值对象以买入成本列示，买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，按实际利率每日计提收益或损失。

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，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。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偏离度的绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，基金管理人与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。如有新增事项，按最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回及分红引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

-

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通[2006]22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(4) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基

金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自申购确认之日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自赎回确认之日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 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**

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### **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，本基金计算影子价格过程中确定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：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### **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**

本基金在本报告期间无会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖债券的差价收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

## 7.4.7 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	4,042,378,557.29	3,977,757,138.80
定期存款	33,290,000,000.00	11,300,000,000.00
其中: 存款期限 1 个月以内	-	700,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,550,000,000.00	800,000,000.00
存款期限 3 个月以上	31,740,000,000.00	9,800,000,000.00
其他存款	-	-
合计:	37,332,378,557.29	15,277,757,138.80

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 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	38,101,398,777.31	38,191,622,000.00	90,223,222.69	0.1031%
	合计	38,101,398,777.31	38,191,622,000.00	90,223,222.69	0.1031%
资产支持证券	-	-	-	0.0000%	
合计	38,101,398,777.31	38,191,622,000.00	90,223,222.69	0.1031%	

项目		上年度末 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	199,887,164.23	199,560,000.00	-327,164.23	-0.0007%
	银行间市场	26,969,047,036.35	27,084,800,400.00	115,753,363.65	0.2515%
	合计	27,168,934,200.58	27,284,360,400.00	115,426,199.42	0.2507%
资产支持证券		-	-	-	-
合计		27,168,934,200.58	27,284,360,400.00	115,426,199.42	0.2507%

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 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,459,700,000.00	-
银行间市场	16,168,878,065.44	-
合计	17,628,578,065.44	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,344,005,000.00	-



银行间市场	8,273,124,489.67	-
合计	10,617,129,489.67	-

#### 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	3,767,141.60	4,364,020.09
应收定期存款利息	279,809,842.49	122,888,026.85
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	47,029.18	14,490.41
应收债券利息	45,410,178.53	133,083,966.65
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	27,413,831.23	19,854,419.97
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	53.68	21.23
合计	356,448,076.71	280,204,945.20

注：应收债券利息包含资产支持证券利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018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	857,544.38	800,513.52
合计	857,544.38	800,513.52

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019年12月31日	2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	-	-
预提审计费	90,000.00	96,000.00
预提信息披露费	190,000.00	190,000.00
预提账户服务费	9,000.00	9,000.00
合计	289,000.00	295,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	46,034,278,763.80	46,034,278,763.80
本期申购	710,991,610,011.25	710,991,610,011.25
本期赎回(以“-”号填列)	-669,540,103,135.01	-669,540,103,135.01
- 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	87,485,785,640.04	87,485,785,640.04

注：申购含红利再投资。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	1,932,929,185.78	-	1,932,929,185.78
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	-1,932,929,185.78	-	-1,932,929,185.78
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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	131,823,599.20	181,063,413.94
定期存款利息收入	686,878,274.00	600,082,313.10
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,146,463.98	874,002.44
其他	1,963.93	161.60
合计	819,850,301.11	782,019,891.08

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期间及上年度可比期间均无股票投资收益。

### 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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	-156,854,853.01	-99,834,854.87
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	-156,854,853.01	-99,834,854.87

#### 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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	237,846,431,467.42	219,712,679,260.71
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	237,231,120,294.54	218,952,581,996.39
减：应收利息总额	772,166,025.89	859,932,119.19
买卖债券差价收入	-156,854,853.01	-99,834,854.87

#### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年1月1日至2019年 12月31日	2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	-	45,166,509.94
减：卖出资产支持证券成本总额	-	44,953,566.71
减：应收利息总额	-	206,509.94
资产支持证券投资收益	-	6,433.29

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未获得股利收益。

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年 12月31日	2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	314,218.95
合计	-	314,218.95

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	574.00	2,743.31
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	574.00	2,743.31

#### 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
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	96,000.00
信息披露费	120,000.00	190,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,650.00	1,200.00
银行汇划费	174,235.00	153,835.00
账户服务费	36,000.00	36,000.00
合计	421,885.00	477,035.00

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2020 年 3 月 18 日由“兴全基金管理有限公司”更名为“兴证全球基金管理有限公司”。

除以上情况外，本基金无其他需要披露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
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
兴业证券	2,103,305,244.46	100.00%	580,016,981.42	100.00%

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
兴业证券	163,128,795,000.00	100.00%	134,602,880,000.00	100.00%

**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 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	191,777,722.69
其中：支付销售机构的客户维护费	78,802,582.67	9,893,864.91

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.27%/当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31 日



当期发生的基金应支付的托管费	35,514,393.05	27,709,086.17
----------------	---------------	---------------

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
兴全基金管理有限公司	18,380,477.53	
兴业银行	54,919,106.95	
合计	73,299,584.48	
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 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	
兴全基金管理有限公司	138,545,431.19	
合计	138,545,431.19	

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，由基金管理人代付给各基金销售机构。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金销售服务费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 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 2019年1月1日至2019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	3,034,836,970.00	-	-	-	89,462,546,000.00	7,481,667.04

兴业证券	498,856,000.00	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	9,493,662,050.00	-	-	-	34,948,000,000.00	4,075,252.34

#### 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
报告期初持有的基金份额	370,565,705.12	64,939,788.98
报告期间申购/买入总份额	257,881,454.58	1,697,560,242.06
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	426,000,000.00	1,391,934,325.92
报告期末持有的基金份额	202,447,159.70	370,565,705.12
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2314%	0.8050%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末
	2019年12月31日	2018年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
兴业证券	91,092,372.07	0.1041%	524,944,202.91	1.1403%
兴全睿众	33,083,746.08	0.0378%	28,463,586.77	0.0618%
兴业银行	1,393,328,348.11	1.5926%	7,604,523,120.36	16.5193%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 7.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年12月31 日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	8,042,378,557.29	159,897,766.92	3,977,757,138.80

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 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 1,500,000,000.00 元，估值总额 1,481,238,653.60 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

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
1,932,929,185.78	-	-	1,932,929,185.78	-

**7.4.12 ( 2019 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**

本基金本年末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 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临时停牌等流通受限证券。

**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 2019 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 4,524,252,592.77 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
100213	10 国开 13	2020 年 1 月 2 日	99.72	5,500,000	548,432,529.64
111909418	19 浦发银 行 CD418	2020 年 1 月 2 日	99.57	2,250,000	224,041,910.69
111910114	19 兴业银 行 CD114	2020 年 1 月 2 日	99.34	1,160,000	115,237,957.13
111910475	19 兴业银 行 CD475	2020 年 1 月 2 日	99.54	1,000,000	99,540,456.35
111910518	19 兴业银 行 CD518	2020 年 1 月 2 日	97.05	250,000	24,261,922.66
111915076	19 民生银 行 CD076	2020 年 1 月 2 日	99.41	1,500,000	149,114,804.81
111915079	19 民生银 行 CD079	2020 年 1 月 2 日	99.40	3,000,000	298,192,157.60
111915466	19 民生银 行 CD466	2020 年 1 月 2 日	99.18	4,000,000	396,729,229.65
150208	15 国开 08	2020 年 1 月 2 日	100.40	1,300,000	130,521,904.91

150415	15 农发 15	2020 年 1 月 2 日	100.39	700,000	70,270,115.91
170205	17 国开 05	2020 年 1 月 2 日	100.32	6,100,000	611,969,927.54
180405	18 农发 05	2020 年 1 月 2 日	100.36	1,200,000	120,431,781.54
190206	19 国开 06	2020 年 1 月 2 日	99.98	5,100,000	509,916,176.48
199948	19 贴现国 债 48	2020 年 1 月 2 日	99.07	5,200,000	515,151,174.69
111915121	19 民生银 行 CD121	2020 年 1 月 3 日	98.99	735,000	72,756,102.49
111915278	19 民生银 行 CD278	2020 年 1 月 3 日	99.17	1,000,000	99,170,602.93
111971285	19 中原银 行 CD343	2020 年 1 月 6 日	98.82	3,000,000	296,458,738.36
111983077	19 徽商银 行 CD048	2020 年 1 月 6 日	97.89	1,890,000	185,011,262.89
111984431	19 中原银 行 CD238	2020 年 1 月 6 日	98.68	100,000	9,868,083.59
111986320	19 徽商银 行 CD073	2020 年 1 月 6 日	97.50	2,980,000	290,562,415.53
111998787	19 中原银 行 CD155	2020 年 1 月 6 日	98.51	1,000,000	98,512,607.74
合计				48,965,000	4,866,151,863.13

#### 7.4.12.3.2 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。

## 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。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，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、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 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。本基金均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；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，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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	149,999,069.47	1,455,006,441.44
A-1 以下	-	-
未评级	99,444,243.21	180,344,509.44
合计	249,443,312.68	1,635,350,950.88

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	200,864,323.14	1,610,629,497.09
AAA 以下	90,206,141.81	449,160,128.34
未评级	-	-
合计	291,070,464.95	2,059,789,625.43

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	31,010,716,186.68	20,236,830,809.01
AAA 以下	4,043,475,202.29	1,528,743,190.76
未评级	-	-
合计	35,054,191,388.97	21,765,573,999.77

注：此处为主体信用评级。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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，另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。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注 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。

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部门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。

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

### 7.4.13.3.2 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未超过基金总份额 20%，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年 以 上	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,942,378,557.29	20,850,000,000.00	10,540,000,000.00	-	-	-	37,332,378,557.29
结算备付金	95,008,582.49	-	-	-	-	-	95,008,582.49



存出保证金	108,401.16	-	-	-	-	108,401.16
交易性金融资产	1,347,215,738.90	14,880,333,224.92	21,873,849,813.49	-	-	38,101,398,777.31
买入返售金融资产	15,521,968,545.51	2,106,609,519.93	-	-	-	17,628,578,065.44
应收利息	-	-	-	-	356,448,076.71	356,448,076.71
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,906,679,825.35	37,836,942,744.85	32,413,849,813.49	-	356,448,076.71	93,513,920,460.40
负债						
卖出回购金融资产款	4,524,252,592.77	-	-	-	-	4,524,252,592.77
应付证券清算款	-	-	-	-	1,459,700,000.00	1,459,700,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	19,931,055.29	19,931,055.29
应付托管费	-	-	-	-	3,690,936.17	3,690,936.17
应付销售服务费	-	-	-	-	18,454,680.85	18,454,680.85
应付交易费用	-	-	-	-	857,544.38	857,544.38
应付利息	-	-	-	-	893,853.51	893,853.51
应交税费	-	-	-	-	65,157.39	65,157.39
其他负债	-	-	-	-	289,000.00	289,000.00
负债总计	4,524,252,592.77	-	-	-	1,503,882,227.59	6,028,134,820.36
利率敏感度缺口	18,382,427,232.58	37,836,942,744.85	32,413,849,813.49	-	-1,147,434,150.88	87,485,785,640.04
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年 以上	5 年 以上 不计息	合计
资产						
银行存款	6,077,757,138.80	5,200,000,000.00	4,000,000,000.00	-	-	15,277,757,138.80
结算备付金	29,273,638.24	-	-	-	-	29,273,638.24
存出保证金	42,981.37	-	-	-	-	42,981.37
交易性金融资产	359,741,973.20	5,730,183,027.74	21,079,009,199.64	-	-	27,168,934,200.58
买入返售金融资产	7,573,695,684.53	3,043,433,805.14	-	-	-	10,617,129,489.67
应收利息	-	-	-	-	280,204,945.20	280,204,945.20
资产总计	14,040,511,416.14	13,973,616,832.88	25,079,009,199.64	-	280,204,945.20	53,373,342,393.86
负债						
卖出回购金融资产款	4,835,739,066.36	-	-	-	-	4,835,739,066.36
应付证券清算款	-	-	-	-	2,474,094,041.11	2,474,094,041.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	11,232,406.66	11,232,406.66
应付托管费	-	-	-	-	2,080,075.31	2,080,075.31
应付销售服务费	-	-	-	-	10,400,376.54	10,400,376.54
应付交易费用	-	-	-	-	800,513.52	800,513.52
应付利息	-	-	-	-	4,113,444.80	4,113,444.80
应交税费	-	-	-	-	308,705.76	308,705.76

其他负债	-	-	-	-	295,000.00	295,000.00
负债总计	4,835,739,066.36	-	-	-	2,503,324,563.70	7,339,063,630.06
利率敏感度缺口	9,204,772,349.78	13,973,616,832.88	25,079,009,199.64	-	-2,223,119,618.50	46,034,278,763.80

注：1、表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金合同于 2014 年 2 月 27 日生效。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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(2019年12月31日)	上年度末(2018年12月31日)
	利率+1%	-130,637,477.39	-111,896,665.90
	利率-1%	131,836,455.00	112,979,308.00

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格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，因此无重大市场价格风险。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、卖出回购金融资产及其他金融负债，其账面价值与公允价值接近。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 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 38,101,398,777.31 元，无属于第一层次和第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 27,168,934,200.58 元，无属于第一层次和第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	38,101,398,777.31	40.74
	其中:债券	38,101,398,777.31	40.74
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	17,628,578,065.44	18.85
	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	37,427,387,139.78	40.02
4	其他各项资产	356,556,477.87	0.38
5	合计	93,513,920,460.40	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	9.26	
	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	4,524,252,592.77	5.17
	其中:买断式回购融资	-	-

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 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	25.96	6.84
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	26.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	8.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	31.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.48	6.84

### 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存续期没有发生超过 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	515,151,174.69	0.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,112,390,121.92	2.41

	其中：政策性金融债	1,991,542,436.02	2.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,443,312.68	0.29
6	中期票据	170,222,779.05	0.19
7	同业存单	35,054,191,388.97	40.07
8	其他	-	-
9	合计	38,101,398,777.31	43.55
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	170205	17 国开 05	6,100,000	611,969,927.54	0.70
2	111915466	19 民生银行 CD466	6,000,000	595,093,844.47	0.68
3	111984036	19 广州银行 CD041	6,000,000	592,237,813.04	0.68
4	111914095	19 江苏银行 CD095	6,000,000	591,241,000.53	0.68
5	111916382	19 上海银行 CD382	5,500,000	548,960,949.95	0.63
6	100213	10 国开 13	5,500,000	548,432,529.64	0.63
7	111973822	19 宁波银行 CD249	5,500,000	547,610,312.04	0.63
8	111910475	19 兴业银行 CD475	5,200,000	517,610,373.00	0.59
9	199948	19 贴现国债 48	5,200,000	515,151,174.69	0.59

10	190206	19 国开 06	5,100,000	509,916,176.48	0.58
----	--------	----------	-----------	----------------	------

### 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	35
报告期内偏离度的最高值	0.3228%
报告期内偏离度的最低值	0.0634%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1561%

#### 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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.9.3 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	108,401.16
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	356,448,076.71

4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	356,556,477.87

#### 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

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
8,666,754	10,094.41	4,047,335,551.75	4.63%	83,438,450,088.29	95.37%

### 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	658,960,493.88	0.75%
2	银行类机构	538,402,571.09	0.62%
3	银行类机构	514,172,992.48	0.59%
4	银行类机构	492,769,494.31	0.56%
5	券商类机构	324,304,845.53	0.37%
6	银行类机构	194,664,774.44	0.22%
7	银行类机构	181,322,698.34	0.21%
8	基金类机构	150,434,862.88	0.17%
9	券商类机构	91,092,372.07	0.10%
10	券商类机构	83,318,920.88	0.10%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	58,056,173.64	0.0664%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年2月27日）基金份额总额	1,306,352,581.78
本报告期期初基金份额总额	46,034,278,763.80
本报告期基金总申购份额	710,991,610,011.25
减:本报告期基金总赎回份额	669,540,103,135.01
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	87,485,785,640.04

注：总申购份额含红利再投资份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

2019 年 4 月 12 日公告，自 2019 年 4 月 12 日起，严长胜先生担任公司副总经理，詹鸿飞先生担任公司副总经理暨首席信息官。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起连续 6 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 9.6 万元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	2,103,305,244.46	100.00%	163,128,795,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

### 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 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 1 月 1 日
2	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受五千万元以上申购申请的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 1 月 2 日
3	关于增加蚂蚁基金销售、网商银行为兴全添利宝货币基金销售机构的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 2 月 12 日
4	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受一千万元以上申购申请的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 2 月 12 日
5	兴全添利宝货币市场基金新增转换基金的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 3 月 15 日
6	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台五百万元以	证券日报、指定互联网网站	2019 年 4 月 3 日

	上申购申请的公告		
7	关于增聘副总经理的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 4 月 12 日
8	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台五千万元以上申购申请的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 6 月 18 日
9	关于兴全添利宝货币市场基金经理变更的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 6 月 27 日
10	旗下各基金 2019 年 6 月 30 日资产净值公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 7 月 1 日
11	关于兴全添利宝货币市场基金暂停接受直销柜台五百万元以上申购申请的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 7 月 5 日
12	关于网上直销平台开通赎回转购业务的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 7 月 26 日
13	兴全添利宝货币市场基金开放网上直销平台日常申购及赎回转购业务的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 7 月 26 日
14	关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 11 月 18 日
15	关于调整网上直销基金转换、赎回转购优惠费率的公告	证券日报、指定互联网网站	2019 年 12 月 6 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
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

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。

### 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、中国证监会准予兴全添利宝货币市场基金募集注册的文件
- 2、关于募集兴全添利宝货币市场基金之法律意见书
- 3、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 4、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 5、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》
- 6、《兴全添利宝货币市场基金托管协议》
- 7、中国证监会规定的其他文件

### 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.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。

兴证全球基金管理有限公司

2020年3月25日