

# 兴全添利宝货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。本中期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 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	35
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	36
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	37

7.8 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 .....	37
7.9 投资组合报告附注 .....	37
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	39
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>39</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	40
10.9 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>40</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	40
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	41
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>41</b>
12.1 备查文件目录 .....	41
12.2 存放地点 .....	41
12.3 查阅方式 .....	41

## § 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
基金主代码	000575
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	兴证全球基金管理有限公司
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	131,758,225,345.11 份
基金合同存续期	不定期

### 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	兴证全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东
	联系电话	021-20398888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com
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	杨华辉	吕家进

### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>

基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所
------------	------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-30 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	1,443,624,127.54
本期利润	1,443,624,127.54
本期净值收益率	1.1994%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末基金资产净值	131,758,225,345.11
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
累计净值收益率	28.2413%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、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。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、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

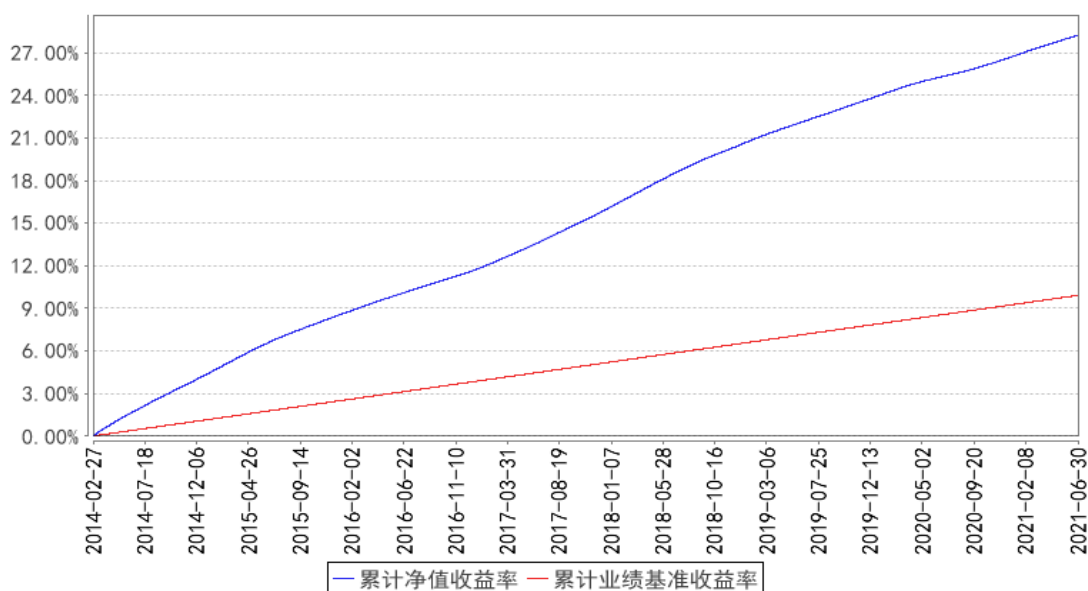
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1832%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0722%	0.0004%
过去三个月	0.5753%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	0.2387%	0.0006%

过去六个月	1.1994%	0.0007%	0.6695%	0.0000%	0.5299%	0.0007%
过去一年	2.3104%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	0.9604%	0.0008%
过去三年	8.1820%	0.0015%	4.0537%	0.0000%	4.1283%	0.0015%
自基金合同生效起 至今	28.2413%	0.0028%	9.9160%	0.0000%	18.3253%	0.0028%

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证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份额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 2021 年 06 月 30 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。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（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”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截止2021年6月30日，公司旗下共42只基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、FOF等不同类型，建立了覆盖高中低等级的公募基金产品线，为各类风险偏好的投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

#### 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	固定收益部副总监，兴全添利宝货币市场基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、	2016年3月17日	-	11年	医学硕士，历任毕马威华振会计师事务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴证全球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、兴全兴泰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基金经理、固定收益部总监助理。



	兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理				
邓娟	兴全添利宝货币市场基金、兴全货币市场基金基金经理	2019 年 6 月 26 日	-	6 年	硕士。历任兴证全球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。

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、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

4、基金经理邓娟女士自 2020 年 8 月 17 日起休假（产假），并于 2021 年 1 月 13 日结束休假，在此期间本基金基金经理相关职责由王健女士代为履行。

## 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。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合相关法规规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人在流动性许可和对净值影响可控的前提下积极进行调整。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债券市场收益先上后下，整体下行。一季度，国外疫苗接种推进，疫情控制好转，国内经济平稳运行，通胀预期上升，叠加 1 月末央行公开市场投放不及预期，资金面超预期紧张，市场担忧货币政策收紧，债券收益上行。二季度后，国内经济持续复苏，大宗商品价格上涨带动国内 PPI 上升至高位，但核心 CPI 仍处于低位。国内坚持稳货币和紧信用的政策组合，资金面持续宽松叠加财政后置，机构配置压力加大，债券收益震荡下行，曲线趋平。

在此背景下，本组合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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0000 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.1994%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度以来，国内经济虽维持复苏，但动能有所弱化，叠加严控房地产融资的政策态度未变，国内新冠疫情反复，下半年经济增长存在一定压力。在经济增长压力增加，紧信用维持，国内债务压力较大的背景下，央行货币政策中性偏松的概率较大。但下半年财政是否发力，地方债发行规模及美联储退出 QE 节奏可能对市场存在一定扰动。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系

统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全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。本基金本报告期内向基金份额持有人分配利润 1,443,624,127.54 元，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	31,526,626,790.44	30,856,644,567.69
结算备付金		260,109,364.18	182,186,413.75
存出保证金		270,234.72	174,619.27
交易性金融资产	6.4.7.2	66,609,505,386.90	53,261,078,866.08
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		66,609,505,386.90	53,261,078,866.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	42,507,938,025.79	29,622,291,806.61
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	586,155,261.57	469,511,110.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		141,490,605,063.60	114,391,887,384.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,995,493,073.47	6,061,822,975.09
应付证券清算款		3,673,800,000.00	2,400,144,237.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		28,640,186.19	24,495,456.28
应付托管费		5,303,738.17	4,536,195.62
应付销售服务费		26,518,690.92	22,680,978.07
应付交易费用	6.4.7.7	1,144,206.37	807,241.08
应交税费		410,933.64	446,081.49
应付利息		939,351.38	937,180.21

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,538.35	219,000.00
负债合计		9,732,379,718.49	8,516,089,345.71
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	131,758,225,345.11	105,875,798,038.62
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		131,758,225,345.11	105,875,798,038.62
负债和所有者权益总计		141,490,605,063.60	114,391,887,384.33

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 131,758,225,345.11 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,850,065,954.66	1,436,672,489.23
1. 利息收入		1,867,267,494.64	1,466,307,772.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	606,948,463.57	585,990,961.00
债券利息收入		838,240,013.86	623,207,992.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		422,079,017.21	257,108,818.82
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,201,539.98	-29,635,282.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-17,201,539.98	-29,635,282.83
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 18	-	-
减：二、费用		406,441,827.12	366,141,193.46
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	162,319,570.80	128,458,723.15
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	30,059,179.74	23,788,652.45
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	150,295,898.91	118,943,262.16
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	1,101.50	969.63
5. 利息支出		63,295,634.18	94,703,899.80
其中：卖出回购金融资产支出		63,295,634.18	94,703,899.80
6. 税金及附加		262,453.64	54,505.13
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	207,988.35	191,181.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,443,624,127.54	1,070,531,295.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,443,624,127.54	1,070,531,295.77

### 6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	105,875,798,038.62	-	105,875,798,038.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,443,624,127.54	1,443,624,127.54
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）	25,882,427,306.49	-	25,882,427,306.49
其中：1. 基金申购款	763,673,893,003.43	-	763,673,893,003.43
2. 基金赎回款	-737,791,465,696.94	-	-737,791,465,696.94
四、本期向基金	-	-1,443,624,127.54	-1,443,624,127.54

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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	131,758,225,345.11	-	131,758,225,345.11
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	87,485,785,640.04	-	87,485,785,640.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,070,531,295.77	1,070,531,295.77
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）	9,103,639,644.16	-	9,103,639,644.16
其中：1. 基金申购款	627,008,440,004.32	-	627,008,440,004.32
2. 基金赎回款	-617,904,800,360.16	-	-617,904,800,360.16
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）	-	-1,070,531,295.77	-1,070,531,295.77
五、期末所有者权益（基金净值）	96,589,425,284.20	-	96,589,425,284.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全添利宝货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司

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[2015]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。《兴全添利宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 2 月 27 日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司,托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金投资范围是以下金融工具: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)。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。



#### 6.4.6 税项

根据财政部、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[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]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《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; 2018年1月1日起, 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, 暂不计缴企业所得税。

3) 基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	4,046,626,790.44
定期存款	27,480,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	3,700,000,000.00
存款期限3个月以上	23,780,000,000.00
其他存款	-
合计	31,526,626,790.44

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券   交易所市场	3,928,931,429.35	3,924,096,000.00	-4,835,429.35	-0.0037

	银行间市场	62,680,573,957.55	62,770,320,000.00	89,746,042.45	0.0681
	合计	66,609,505,386.90	66,694,416,000.00	84,910,613.10	0.0644
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	66,609,505,386.90	66,694,416,000.00	84,910,613.10	0.0644

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。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,600,829,000.00	-
银行间市场	33,907,109,025.79	-
合计	42,507,938,025.79	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,484,934.86
应收定期存款利息	245,269,514.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	117,049.20
应收债券利息	297,200,685.41
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	40,082,956.50
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	121.60
合计	586,155,261.57

## 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	1,144,206.37
合计	1,144,206.37

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30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	-
银行汇划费	16,400.00
预提账户服务费	9,000.00
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	44,630.98
合计	129,538.35

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	105,875,798,038.62	105,875,798,038.62
本期申购	763,673,893,003.43	763,673,893,003.43
本期赎回（以“-”号填列）	-737,791,465,696.94	-737,791,465,696.94
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	131,758,225,345.11	131,758,225,345.11

注：申购含红利再投资。

## 6.4.7.10 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	1,443,624,127.54	-	1,443,624,127.54
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	-1,443,624,127.54	-	-1,443,624,127.54
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入	65,705,525.20	
定期存款利息收入	539,440,819.55	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	1,800,477.50	
其他	1,641.32	
合计	606,948,463.57	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-17,201,539.98	
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	-17,201,539.98	

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	130,157,804,487.66	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	129,624,160,853.11	

减：应收利息总额	550,845,174.53
买卖债券差价收入	-17,201,539.98

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

#### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内未获得股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	1,101.50
合计	1,101.50

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户服务费	18,300.00
银行汇划费	85,550.00
合计	207,988.35

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴证全球资本管理（上海）有限公司（“兴证全球资本”）	基金管理人控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

注：股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	3,984,107,538.19	100.00	3,458,632,755.83	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比例 (%)
兴业证券	255,584,545,000.00	100.00	234,341,508,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：权证不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	162,319,570.80	128,458,723.15
其中：支付销售机构的客户维护费	79,598,525.75	73,577,874.34

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 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=前一日基金资产净值×0.27%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元



项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,059,179.74	23,788,652.45

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	兴全添利宝货币
兴证全球基金	2,859,519.13
兴业银行	12,953,916.78
合计	15,813,435.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	兴全添利宝货币
兴证全球基金	3,400,827.33
兴业银行	18,217,204.10
合计	21,618,031.43

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。

本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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	2,855,928,830.00	-	-	-	19,175,990,000.00	1,584,469.07
上年度可比期间						
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日						

银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	33,234,055,000.00	1,953,596.42

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
基金合同生效日（2014年2月27日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	247,577,050.07	202,447,159.70
报告期间申购/买入总份额	244,593,191.93	42,384,517.65
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	47,382.77	0.00
报告期末持有的基金份额	492,122,859.23	244,831,677.35
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3735%	0.2535%

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。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2021年6月30日		2020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	1,241,462.73	0.0009	1,226,736.46	0.0012
兴证全球资本	61,578,543.47	0.0467	38,893,737.14	0.0367

注：1、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

2、2020 年 6 月 19 日，“兴全睿众资产管理有限公司”公司名称变更为“兴证全球资本管理（上海）有限公司”。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	9,446,626,790.44	106,913,108.60	6,516,736,204.72	94,775,845.21

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至本报告期末，管理人持有的关联方兴业银行发行的同业存单面额 1,000,000,000.00 元，估值总额 993,123,872.11 元。

注：管理人持有的关联方发行的同业存单估值总额按照摊余成本法计算。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
1,443,624,127.54	-	-	1,443,624,127.54	-

#### 6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,995,493,073.47 元，是以如下债券作为抵押：

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
112009478	20 浦发银行 CD478	2021 年 7 月 1 日	99.69	9,250,000	922,134,689.50
112010351	20 兴业银行 CD351	2021 年 7 月 1 日	99.48	7,390,000	735,144,597.86
112011285	20 平安银行 CD285	2021 年 7 月 1 日	99.78	5,000,000	498,900,687.14
112109166	21 浦发银行 CD166	2021 年 7 月 1 日	99.85	10,000,000	998,538,675.62
120213	12 国开 13	2021 年 7 月 1 日	101.17	300,000	30,350,078.27
170403	17 农发 03	2021 年 7 月 1 日	100.60	620,000	62,372,549.81
180412	18 农发 12	2021 年 7 月 1 日	100.31	3,500,000	351,081,682.74
190202	19 国开 02	2021 年 7 月 1 日	100.27	3,340,000	334,910,089.43
190303	19 进出 03	2021 年 7 月 1 日	100.28	5,800,000	581,617,512.30
200409	20 农发 09	2021 年 7 月 1 日	100.03	1,060,000	106,028,778.38
210301	21 进出 01	2021 年 7 月 1 日	100.06	14,660,000	1,466,864,509.57
170206	17 国开 06	2021 年 7 月 6 日	101.14	3,900,000	394,427,676.14
合计				64,820,000	6,482,371,526.76

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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、风险管理部和合规管理部和审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金主要投资于银行定期存款、国债、央行票据和具有良好信用等级的其他债券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金的银行存款主要存放于本基金的托管人兴业银行和其他信用良好的境内商业银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大；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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	3,746,674,292.26	3,486,927,065.33
A-1 以下	-	-
未评级	5,627,143,434.36	3,210,558,115.21
合计	9,373,817,726.62	6,697,485,180.54

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。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	8,208,186,323.74	2,756,604,034.73
AAA 以下	100,193,303.25	-
未评级	-	-
合计	8,308,379,626.99	2,756,604,034.73

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	44,853,306,788.32	35,768,312,556.24
合计	44,853,306,788.32	35,768,312,556.24

注：此处为主体信用评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易。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。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，本基金前十名份额持有人持有基金份额比例未超过基金总份额 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。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,746,626,790.44	9,400,000,000.00	12,380,000,000.00	-	-	-	31,526,626,790.44
结算备付金	260,109,3	-	-	-	-	-	-260,109,364.

	64.18						18
存出保证金	270,234.72	-	-	-	-	-	270,234.72
交易性金融资产	7,364,872,115.91	29,562,390,235.95	29,682,243,035.04				66,609,505,386.90
买入返售金融资产	40,515,847,557.66	1,992,090,468.13					42,507,938,025.79
应收利息						586,155,261.57	586,155,261.57
资产总计	57,887,726,062.91	40,954,480,704.08	42,062,243,035.04			586,155,261.57	141,490,605,063.60
负债							
应付管理人报酬						28,640,186.19	28,640,186.19
应付托管费						5,303,738.17	5,303,738.17
应付证券清算款						3,673,800,000.00	3,673,800,000.00
卖出回购金融资产款	5,995,493,073.47						5,995,493,073.47
应付销售服务费						26,518,690.92	26,518,690.92
应付交易费用						1,144,206.37	1,144,206.37
应付利息						939,351.38	939,351.38
应交税费						410,933.64	410,933.64
其他负债						129,538.35	129,538.35
负债总计	5,995,493,073.47					3,736,886,645.02	9,732,379,718.49
利率敏感度缺口	51,892,232,989.44	40,954,480,704.08	42,062,243,035.04			-3,150,731,383.45	131,758,225,345.11
上年度末							
2020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	5,056,644,567.69	13,500,000,000.00	12,300,000,000.00				30,856,644,567.69
结算备付金	182,186,413.75						182,186,413.75
存出保证金	174,619.2						174,619.2



	7						
交易性金融资产	918,389,281.07	26,231,802,004.54	26,110,887,580.47				53,261,078,866.08
买入返售金融资产	29,527,291,544.11	95,000,262.50					29,622,291,806.61
应收利息						469,511,110.93	469,511,110.93
资产总计	35,684,686,425.89	39,826,802,267.04	38,410,887,580.47			469,511,110.93	114,391,887,384.33
负债							
应付管理人报酬						24,495,456.28	24,495,456.28
应付托管费						4,536,195.62	4,536,195.62
应付证券清算款						2,400,144,237.87	2,400,144,237.87
卖出回购金融资产款	6,061,822,975.09						6,061,822,975.09
应付销售服务费						22,680,978.07	22,680,978.07
应付交易费用						807,241.08	807,241.08
应付利息						937,180.21	937,180.21
应交税费						446,081.49	446,081.49
其他负债						219,000.00	219,000.00
负债总计	6,061,822,975.09					2,454,266,370.62	8,516,089,345.71
利率敏感度缺口	29,622,863,450.80	39,826,802,267.04	38,410,887,580.47			-1,984,755,259.69	105,875,798,038.62

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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)。	
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	

	动	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	利率+1%	-205,438,895.08	-169,719,178.45
	利率-1%	207,414,536.04	171,179,430.07

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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	66,609,505,386.90	47.08
	其中：债券	66,609,505,386.90	47.08
	资产支持证	-	-

	券		
2	买入返售金融资产	42,507,938,025.79	30.04
	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	31,786,736,154.62	22.47
4	其他各项资产	586,425,496.29	0.41
5	合计	141,490,605,063.60	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.10	
	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	5,995,493,073.47	4.55
	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，故金额处不予填列。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	42.05	7.34
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	23.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.32	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	27.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		106.94	7.34

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,442,409,974.47	7.17
	其中：政策性 金融债	4,074,001,244.97	3.09
4	企业债券	3,928,931,429.35	2.98
5	企业短期融 资券	7,855,907,640.85	5.96
6	中期票据	528,949,553.91	0.40
7	同业存单	44,853,306,788.32	34.04
8	其他	-	-
9	合计	66,609,505,386.90	50.55
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	112198602	21 宁波银行 CD100	20,000,000	1,967,618,523.71	1.49
2	210301	21 进出 01	15,000,000	1,500,884,559.59	1.14
3	112011198	20 平安银行 CD198	13,000,000	1,296,100,886.93	0.98

4	112009478	20 浦发银行 CD478	12,500,000	1,246,127,958.79	0.95
5	012100725	21 中油股 SCP001	11,000,000	1,099,278,480.88	0.83
6	112109166	21 浦发银行 CD166	10,000,000	998,538,675.62	0.76
7	112183126	21 杭州银行 CD120	10,000,000	998,465,438.35	0.76
8	112181540	21 宁波银行 CD140	10,000,000	981,442,777.03	0.74
9	112010351	20 兴业银行 CD351	9,000,000	895,304,652.33	0.68
10	1828019	18 平安银行 01	8,100,000	812,028,269.36	0.62

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1450%
报告期内偏离度的最低值	0.0266%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0816%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内本基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

#### 7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，杭州银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、

平安银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	270,234.72
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	586,155,261.57
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	586,425,496.29

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
11,717,577	11,244.49	1,021,132,747.98	0.78	130,737,092,597.13	99.22

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	基金类机构	492,005,852.81	0.37
2	个人	86,270,435.36	0.07
3	保险类机构	72,380,891.84	0.05
4	券商类机构	66,648,324.57	0.05
5	基金类机构	61,578,543.47	0.05
6	个人	59,620,593.56	0.05
7	券商类机构	50,614,124.51	0.04
8	券商类机构	46,205,410.30	0.04
9	其他机构	42,111,587.14	0.03

10	其他机构	36,984,218.79	0.03
----	------	---------------	------

### 8.3 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	153,674,914.84	0.1166

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	10~50

## § 9 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	105,875,798,038.62
本报告期基金总申购份额	763,673,893,003.43
减：本报告期基金总赎回份额	737,791,465,696.94
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	131,758,225,345.11

注：总申购份额含红利再投资份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。
- (2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	3,984,107,538.19	100.00%	255,584,545,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

## 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于开通网上直销“一步汇”现金宝大额转入功能的公告	证券日报、指定互联网网站	2021 年 04 月 01 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况



别	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

基金管理人客户服务电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日