

兴全天添益货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

2017 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：2018 年 3 月 30 日

§ 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 2018 年 3 月 29 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 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全天添益货币	
基金主代码	001820	
场内简称	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 5 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	7,624,096,157.15 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:	兴全天添益货币 A	兴全天添益货币 B
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	001820	001821
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	5,187,869.43 份	7,618,908,287.72 份

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。	
	兴全天添益货币 A	兴全天添益货币 B
下属分级基金的风险收益特征	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。	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	冯晓莲	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	-
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2017 年		2016 年		2015 年 11 月 5 日(基金合同生 效日)-2015 年 12 月 31 日	
	兴全天添益货 币 A	兴全天添益货币 B	兴全天添益货 币 A	兴全天添益货币 B	兴全天添益 货币 A	兴全天添益货 币 B
本期 已实 现收 益	314,624.55	424,495,934.53	61,696.80	193,414,192.13	3,523.94	998,161.06
本期 利润	314,624.55	424,495,934.53	61,696.80	193,414,192.13	3,523.94	998,161.06
本期 净值 收益 率	3.9445%	4.1947%	2.6677%	2.9144%	-	-
3.1.2 期末 数据 和指 标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	5,187,869.43	7,618,908,287.72	3,301,186.50	8,194,412,353.19	985,783.15	700,998,161.06
期末 基金 资产 净值	5,187,869.43	7,618,908,287.72	3,301,186.50	8,194,412,353.19	985,783.15	700,998,161.06
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本基金收益分配按日结转份额。

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

兴全天添益货币 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	----------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去三个月	1.0021%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.6618%	0.0011%
过去六个月	1.9937%	0.0022%	0.6805%	0.0000%	1.3132%	0.0022%
过去一年	3.9445%	0.0017%	1.3500%	0.0000%	2.5945%	0.0017%
自基金合同生效起至今	7.0801%	0.0027%	2.9145%	0.0000%	4.1656%	0.0027%

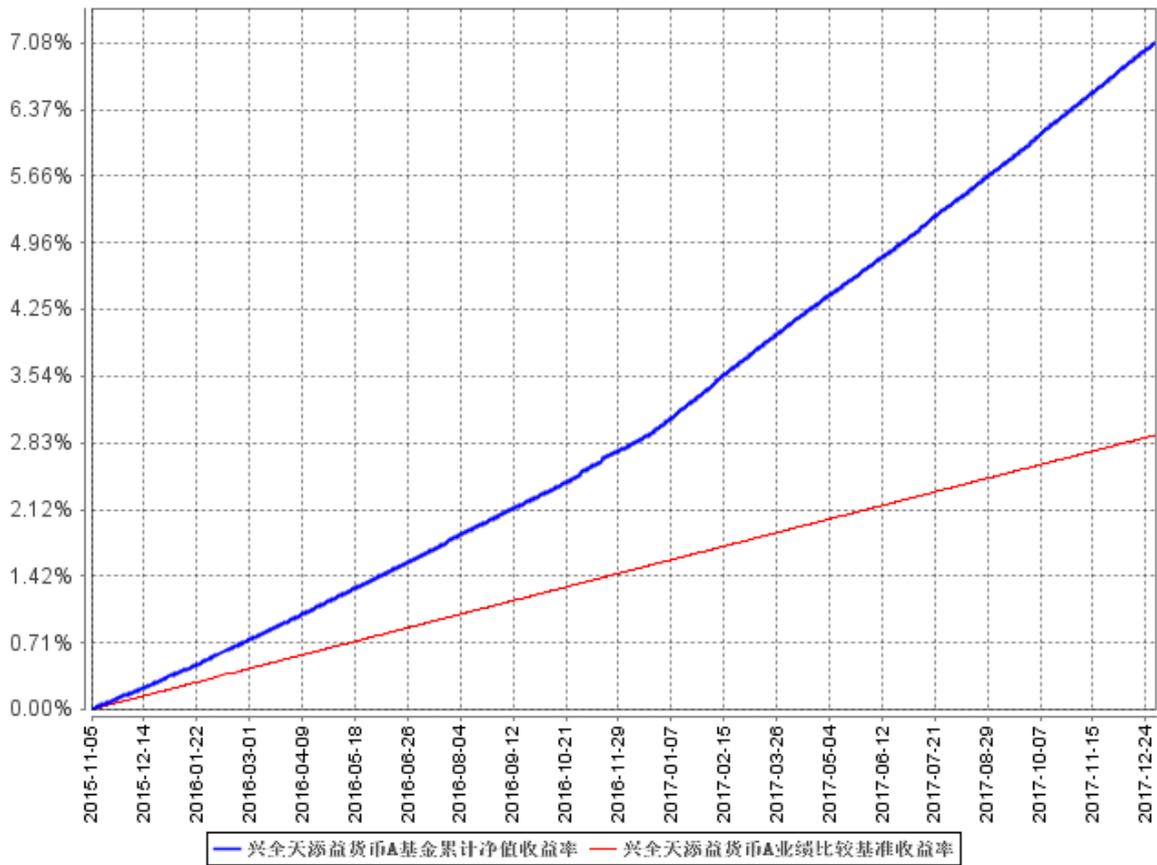
兴全天添益货币 B

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	1.0639%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.7236%	0.0011%
过去六个月	2.1181%	0.0022%	0.6805%	0.0000%	1.4376%	0.0022%
过去一年	4.1947%	0.0017%	1.3500%	0.0000%	2.8447%	0.0017%
自基金合同生效起至今	7.6356%	0.0027%	2.9145%	0.0000%	4.7211%	0.0027%

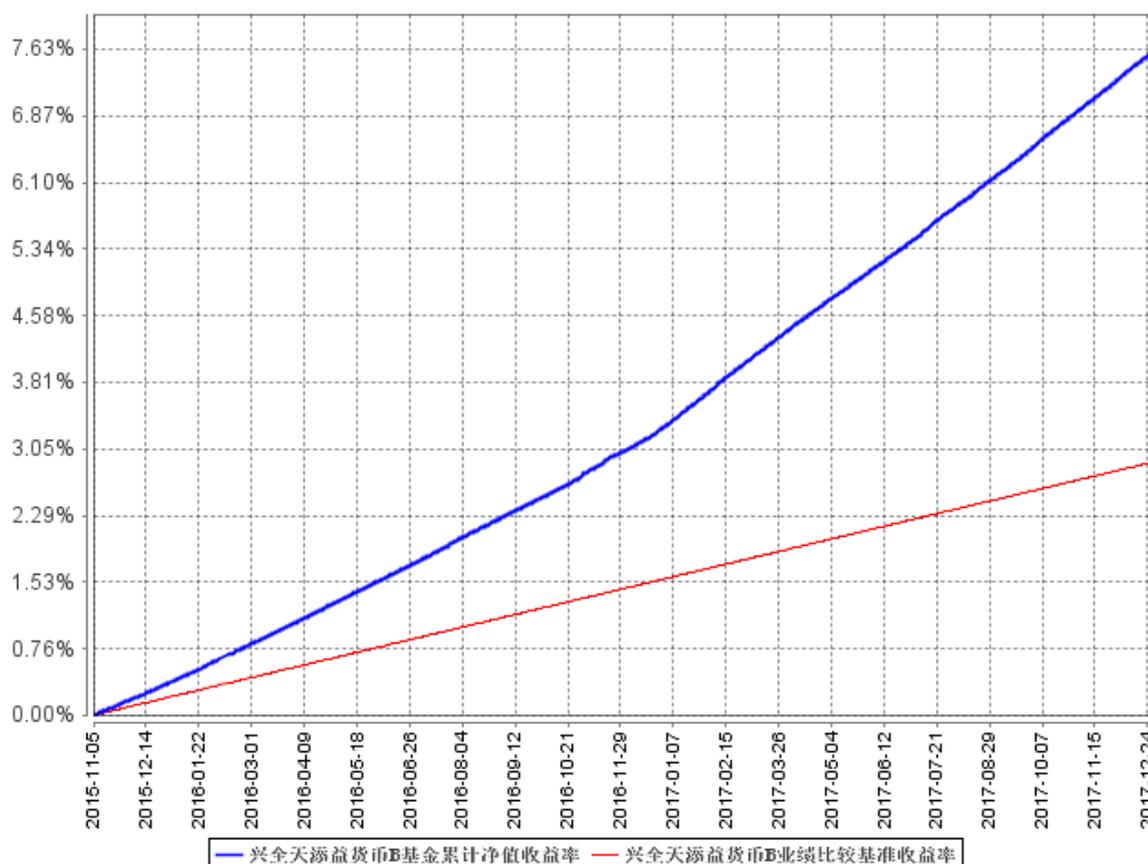
注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴全基金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

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

兴全天添益货币A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



兴全天添益货币B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

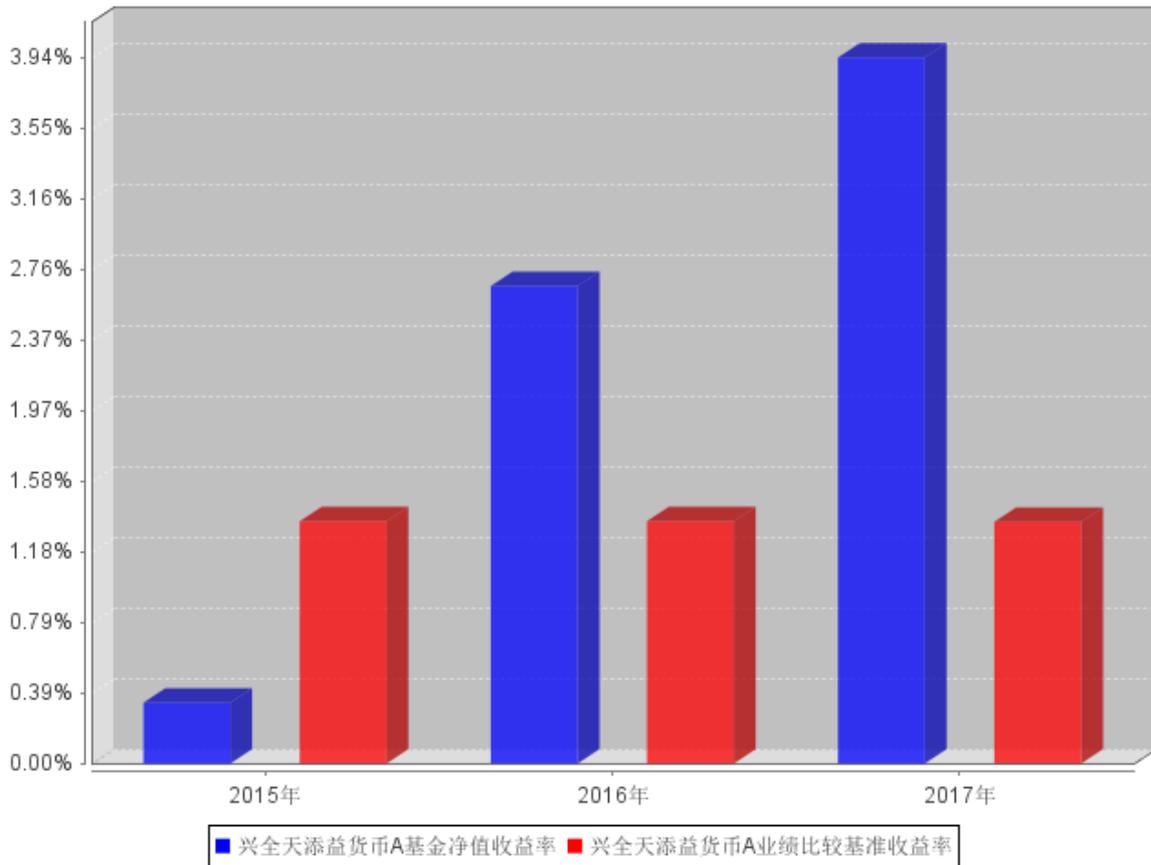


注：1、净值表现所取数据截至到 2017 年 12 月 31 日。

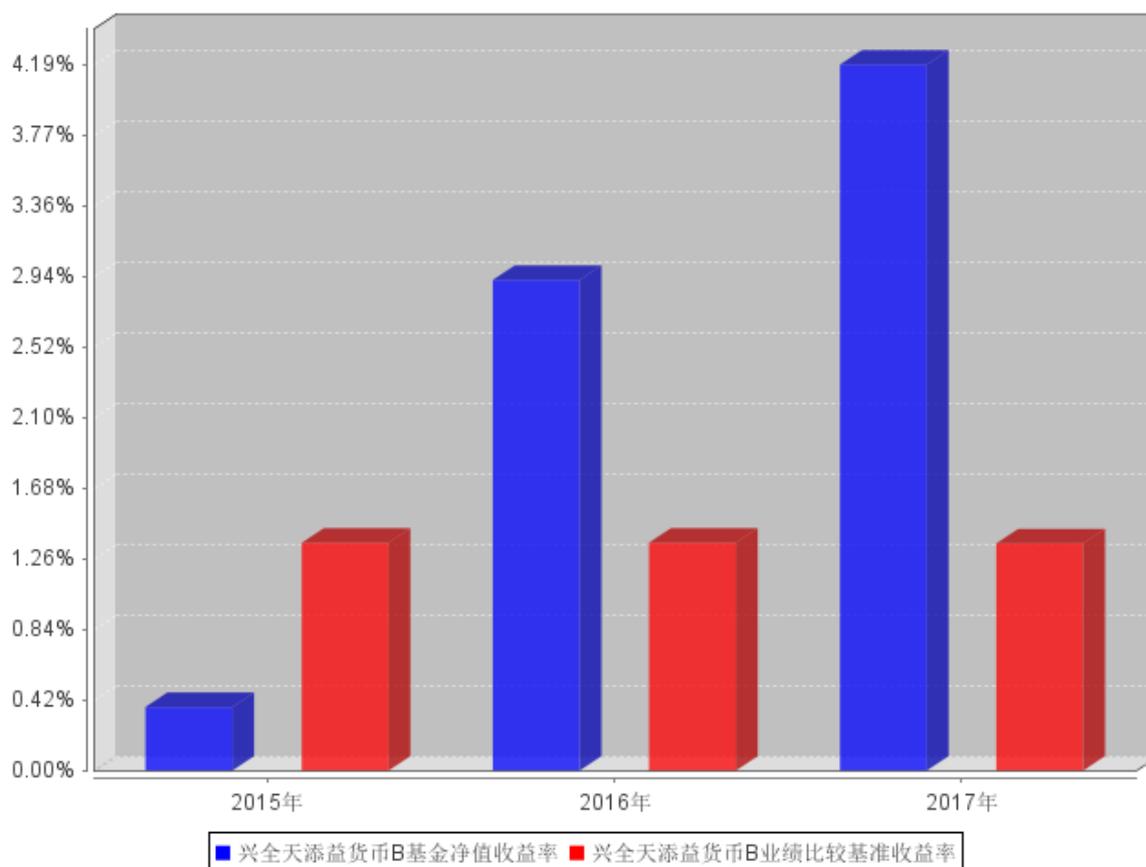
2、按照《兴全天添益货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2015 年 11 月 5 日至 2016 年 5 月 4 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3.2.3 自基金合同生效以来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

兴全天添益货币A自基金合同生效以来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



兴全天添益货币B自基金合同生效以来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：2015年数据统计期间为2015年11月5日（基金合同生效之日）至2015年12月31日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

兴全天添益货币 A					
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
2017	314,624.55	-	-	314,624.55	
2016	61,696.80	-	-	61,696.80	
2015	3,523.94	-	-	3,523.94	
合计	379,845.29	-	-	379,845.29	
兴全天添益货币 B					
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
2017	424,495,934.53	-	-	424,495,934.53	
2016	193,414,192.13	-	-	193,414,192.13	
2015	998,161.06	-	-	998,161.06	

合计	618,908,287.72	-	-	618,908,287.72
----	----------------	---	---	----------------

§ 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2017年12月31日，公司旗下管理着二十只基金，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、兴全稳益债券型证券投资基金、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。

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		
张睿	固定收益部总监助理，本基金、兴全	2015年11月5日	-	12年	经济学硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴

	磐稳增利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基金经理				全基金管理有限公司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理。
翟秀华	本基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全稳益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基金经理	2017年5月4日	-	7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，兴全基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。

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、《兴全稳益债券型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，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量的 5% 的交易次数为 1 次，由组合投资策略导致，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常交易情况。

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

2017 年全年，债券市场经历了大幅调整。在海外经济总体向好，全球流动性收紧及货币政策开始退出宽松，美联储逐步加息，全球利率中枢抬升。国内方面，GDP 保持稳定的较好增长，超出了年初多数经济学家的预测，经济结构在供给侧改革、需求侧升级的牵引下不断优化。在金融防风险的思路引导下，监管层则以强监管、去杠杆为主基调，搭配中性偏紧的货币政策和 MPA 考核；央行先后上调了公开市场、中期借贷等政策性利率，金融机构资金成本中枢上移，债券期限利差不断降低，曲线熊平。

全年来看，在强监管的大背景下，央行中性偏紧的货币政策态度，银行偏低的超储率以及各种流动性指标考核，财政存款季节性波动等，资金面波动很大，金融机构负债端管理压力凸显。且在居民存款搬家的影响下，居民存款不断转化为同业存款，一方面加大了资金价格的波动性，另一方面也大幅抬升了短端利率，同业存单的发行利率节节攀升，带动了长端的上行。运作期内，

考虑到中性偏紧的货币政策和 MPA 考核带来的季度间资金面波动，本基金着重抓住关键时点的配置机会，灵活运用杠杆和久期，积极调整大类资产比例，实现了远超基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期兴全天添益货币 A 的基金份额净值收益率为 3.9445%，本报告期兴全天添益货币 B 的基金份额净值收益率为 4.1947%，同期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

展望 2018 年，全球经济回暖上行，IMF 也进一步上调了全球经济增速预期，在美联储的加息带动下，全球货币政策调整可能会对金融市场、资本流动带来冲击，全球利率中枢可能会进一步抬升。国内方面，经济结构持续优化，工业产能利用率持续攀升，房地产库存下降，供需关系持续改善，消费结构升级和新兴产业快速发展，经济持续发展的有力条件仍然较多。质量优先的发展思路仍将成为国内政策制定的核心出发点，经济增速稳中略降的概率较大。监管方面，预计监管架构调整后将更加适应现在的金融市场混业格局，“去杠杆”仍然是政策主线：金融去杠杆在目前的阶段性成果基础上，继续向深水区推进；宏观去杠杆则任重道远，需要久久为功。货币政策方面，央行双支柱考核的框架将更加明确，中性的货币政策可能会延续；众多流动性监管政策都将在 2018 年开始执行，从而对流动性市场产生影响。债券市场方面，预计资管新规在近期落地，届时银行理财的调整路径可能会对金融市场格局产生较大的影响。

尽管债券市场依然面临着诸多挑战，但债券的投资价值已经凸显，绝对收益达到相对较高水平，预计债券市场将为投资者带来不错的收益。随着金融去杠杆的推进，金融市场流动性的内生稳定性有所增强，极端情况的发生概率降低，但是金融体系负债端格局未实质性改变的前提下，预计流动性仍然会呈现季节性波动，短端利率大幅下行的概率较小，货币基金仍然可以为投资者带来较好的稳定收益。

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估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经验，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》、《兴全天添益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 A 类基金基金份额持有人分配利润 314,624.55 元，向 B 类基金基金份额持有人分配利润 424,495,934.53 元，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

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《兴全天添益货币市场基金基金合同》与《兴全天添益货币市场基金托管协议》，自 2015 年 11 月 5 日起托管兴全天添益货币市场基金（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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师(汪芳)、(侯雯)签字出具了(标准无保留意见)(德师报(审)字(18)第 P01847 号)标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴全天添益货币市场基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,198,257,219.76	12,718,514.03
结算备付金		1,454,545.45	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		4,976,926,105.56	8,156,744,840.03

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,976,926,105.56	7,758,858,530.47
资产支持证券投资		-	397,886,309.56
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		1,392,274,668.41	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		57,121,300.43	29,640,614.41
应收股利		-	-
应收申购款		75,000.00	94,130.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,626,108,839.61	8,199,198,098.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,304,060.67	1,039,986.74
应付托管费		347,749.49	277,329.82
应付销售服务费		88,096.41	70,143.12
应付交易费用		146,275.89	63,099.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		126,500.00	34,000.00
负债合计		2,012,682.46	1,484,558.78
所有者权益：			
实收基金		7,624,096,157.15	8,197,713,539.69
未分配利润		-	-
所有者权益合计		7,624,096,157.15	8,197,713,539.69
负债和所有者权益总计		7,626,108,839.61	8,199,198,098.47

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，兴全天添益货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,187,869.43 份；兴全天添益货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,618,908,287.72 份。兴全天添益货币份额总额合计为 7,624,096,157.15 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全天添益货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		452,058,581.53	212,841,509.61
1.利息收入		454,722,864.53	209,510,537.03
其中：存款利息收入		10,484,020.61	4,152,913.32
债券利息收入		395,432,026.42	187,843,433.24
资产支持证券利息收入		1,534,434.17	14,873,153.68
买入返售金融资产收入		47,272,383.33	2,641,036.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,666,269.07	3,330,972.58
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-2,666,269.07	3,330,972.58
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,986.07	-
减：二、费用		27,248,022.45	19,365,620.68
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	15,597,439.87	9,904,448.31
2.托管费	7.4.8.2.2	4,159,317.26	2,641,186.24
3.销售服务费	7.4.8.2.3	1,059,541.86	665,801.79
4.交易费用		-	-
5.利息支出		6,160,282.84	5,951,041.80
其中：卖出回购金融资产支出		6,160,282.84	5,951,041.80
6.其他费用		271,440.62	203,142.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		424,810,559.08	193,475,888.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		424,810,559.08	193,475,888.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全天添益货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	8,197,713,539.69	-	8,197,713,539.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	424,810,559.08	424,810,559.08
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）	-573,617,382.54	-	-573,617,382.54
其中：1. 基金申购款	4,450,697,870.96	-	4,450,697,870.96
2. 基金赎回款	-5,024,315,253.50	-	-5,024,315,253.50
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）	-	-424,810,559.08	-424,810,559.08
五、期末所有者权益（基金净值）	7,624,096,157.15	-	7,624,096,157.15
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	701,983,944.21	-	701,983,944.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	193,475,888.93	193,475,888.93
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）	7,495,729,595.48	-	7,495,729,595.48
其中：1. 基金申购款	7,509,232,388.07	-	7,509,232,388.07

2. 基金赎回款	-13, 502, 792. 59	-	-13, 502, 792. 59
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）	-	-193, 475, 888. 93	-193, 475, 888. 93
五、期末所有者权益（基金净值）	8, 197, 713, 539. 69	-	8, 197, 713, 539. 69

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

兴全天添益货币市场基金(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》、《兴全天添益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]1872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200,613,630.81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(15)第1593号。《兴全天添益货币市场基金基金合同》于2015年11月5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、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、中国证监会认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发[2017]6号）相关规定，本基金自 2017 年 12 月 11 日起，对所持有的流通受限股票的估值方法进行调整，新的估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《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股票、债券免征营业税和增值税；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其他增值税应税行为，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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

股票不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	-	-	85,828,955.48	100.00%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	4,388,200,000.00	100.00%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

权证不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,597,439.87	9,904,448.31
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 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×0.15%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,159,317.26	2,641,186.24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.04% 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×0.04%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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

	兴全天添益货币 A	兴全天添益货币 B	合计
兴全基金管理有限公司	20,533.93	1,039,007.93	1,059,541.86
合计	20,533.93	1,039,007.93	1,059,541.86
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全天添益货币 A	兴全天添益货币 B	合计
兴全基金管理有限公司	5,734.64	660,067.15	665,801.79
合计	5,734.64	660,067.15	665,801.79

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一定比例计提。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×年销售服务费率/当年天数。本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，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。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类基金份额升级为 B 类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的销售服务费率。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 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	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	-	-	1,598,400,000.00	104,825.72	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

兴全天添益货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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
基金托管人	7,618,908,287.72	99.9320%	8,194,412,353.19	99.9597%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	38,257,219.76	1,162,122.20	12,718,514.03	2,612,442.34

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(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 2017 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 4,973,088,000.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 8,156,744,840.03 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。

§ 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	4,976,926,105.56	65.26
	其中：债券	4,976,926,105.56	65.26
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,392,274,668.41	18.26
	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	1,199,711,765.21	15.73
4	其他各项资产	57,196,300.43	0.75
5	合计	7,626,108,839.61	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	1.88	
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：债券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

本报告期末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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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	43.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	8.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	15.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	浮动利率债		
5	120 天(含)—397 天(含)	24.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.28	-

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未发生超过 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,994,961,834.37	26.17
	其中：政策性金融债	1,994,961,834.37	26.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	280,046,503.37	3.67
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,701,917,767.82	35.44
8	其他	-	-
9	合计	4,976,926,105.56	65.28
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	170410	17 农发 10	6,200,000	618,212,867.66	8.11
2	111718358	17 华夏银行 CD358	5,000,000	495,772,767.58	6.50
3	111784867	17 南京银行 CD155	5,000,000	489,900,001.56	6.43
4	111716005	17 上海银行 CD005	3,800,000	379,481,441.42	4.98

5	170207	17 国开 07	3,500,000	349,236,575.44	4.58
6	111708346	17 中信银行 CD346	3,000,000	299,424,541.35	3.93
7	170204	17 国开 04	2,500,000	249,681,744.72	3.27
8	170203	17 国开 03	2,300,000	229,984,721.02	3.02
9	011764064	17 广州金融 SCP002	2,000,000	199,995,758.21	2.62
10	111717159	17 光大银行 CD159	2,000,000	199,208,588.99	2.61

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	0.2233%
报告期内偏离度的最低值	-0.0953%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0433%

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

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。

8.9.2

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

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	57,121,300.43
4	应收申购款	75,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	57,196,300.43

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
兴全天添益货币 A	472	10,991.25	-	-	5,187,869.43	100.00%
兴全天添益货币 B	1	7,618,908,287.72	7,618,908,287.72	100.00%	-	-
合计	473	16,118,596.53	7,618,908,287.72	99.93%	5,187,869.43	0.07%

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）。

9.3 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	7,618,908,287.72	99.93%
2	个人	335,155.88	0.00%
3	个人	294,898.88	0.00%
4	个人	275,742.94	0.00%
5	个人	235,807.49	0.00%
6	个人	231,696.43	0.00%
7	个人	201,209.24	0.00%
8	个人	181,233.94	0.00%
9	个人	129,402.05	0.00%
10	个人	119,197.89	0.00%

9.4 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	兴全天添益货币 A	87,690.78	1.6903%
	兴全天添益货币 B	-	-
	合计	87,690.78	0.0012%

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）。

9.5 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	兴全天添益货币 A	0~10
	兴全天添益货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全天添益货币 A	0~10

	兴全天添益货币 B	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴全天添益货币 A	兴全天添益货币 B
基金合同生效日（2015 年 11 月 5 日）基金 份额总额	613,658.42	200,009,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,301,186.50	8,194,412,353.19
本报告期基金总申购份额	26,201,936.43	4,424,495,934.53
减:本报告期基金总赎回份额	24,315,253.50	5,000,000,000.00
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	5,187,869.43	7,618,908,287.72

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

兴全天添益货币市场基金于 2017 年 8 月 24 日至 9 月 26 日期间召集基金份额持有人大会，审议《关于修改兴全天添益货币市场基金投资范围、投资限制等有关事项的议案》。本次基金份额持有人大会于 2017 年 9 月 27 日表决通过了《关于修改兴全天添益货币市场基金投资范围、投资限制等有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。

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) 2017 年 1 月 21 日公告，自 2017 年 1 月 19 日起，杨东先生离任公司总经理，由董事长庄园芳女士代任公司总经理。

2) 2017 年 7 月 13 日公告，自 2017 年 7 月 12 日起，庄园芳女士离任公司董事长及法定代表

人；自 2017 年 7 月 13 日起，兰荣先生担任公司董事长及法定代表人，庄园芳女士担任公司总经理。

(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

本基金自基金合同生效日起连续 3 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 5.5 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	-	-	4,388,200,000.00	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%。

§ 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	2017 年 1 月 1 日	8,196,244,668.10	4,423,527,059.22	5,000,000,000.00	7,616,107,251.16	99.93%

		-12 月 31 日					
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
单一机构的集中大额赎回导致的流动性风险。考虑到单一机构占比大，集中赎回可能影响其他投资者的收益，制定投资策略时，管理人考虑到单一客户占比问题，因此组合久期较短，资产流动性较高，同时关注申赎动向，以便及时调整投资策略。							

注：1、“申购金额”指申购、分红再投资导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回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天添益货币 B，分级基金按总份额占比计算。

4、上表列示的单一投资者期末持有份额不包括 2017 年 12 月 30 日及 31 日的待结转收益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴全基金管理有限公司
2018 年 3 月 30 日