

# 兴全货币市场证券投资基金 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
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.....	14
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.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 债券回购融资情况.....	49
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	49
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.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50

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 .....	51
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	51
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 .....	51
8.9 投资组合报告附注 .....	51
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
11.4 基金投资策略的改变 .....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	57
11.9 其他重大事件 .....	57
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</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 .....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	61
13.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全货币市场证券投资基金	
基金简称	兴全货币	
场内简称	-	
基金主代码	340005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 27 日	
基金管理人	兴全基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	38,615,736,072.90 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	兴全货币 A	兴全货币 B
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	340005	004417
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	3,668,155,326.05 份	34,947,580,746.85 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上,使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等,使基金收益达到同期货币市场的收益水平,力争超越业绩比较基准。	
投资策略	本基金通过对货币市场短期金融工具的积极稳健投资,在风险和收益中寻找最优组合,在保持本金安全与资产充分流动性的前提下,综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资,追求稳定的现金收益。	
业绩比较基准	税后 6 个月银行定期存款利率	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。	
	兴全货币 A	兴全货币 B
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	龚小武
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212056
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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	
	兴全货币 A	兴全货币 B	兴全货币 A	兴全货币 B	兴全货币 A	兴全货币 B
本期 已实 现收 益	121,567,811.13	898,121,327.47	316,975,889.70	734,439,085.40	244,200,251.57	461,741,738.56
本期 利润	121,567,811.13	898,121,327.47	316,975,889.70	734,439,085.40	244,200,251.57	461,741,738.56
本期 净值 收益 率	2.6893%	2.9360%	3.9688%	4.2178%	4.2247%	3.3942%
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	3,668,155,326.05	34,947,580,746.85	6,872,870,200.14	19,798,190,970.46	6,632,073,096.01	17,302,196,869.48
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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	53.8807%	10.9188%	49.8507%	7.7551%	44.1305%	3.3942%

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

2、本基金收益分配按月结转份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全货币 A

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	0.6642%	0.0006%	0.3277%	0.0000%	0.3365%	0.0006%
过去六个月	1.3128%	0.0006%	0.6553%	0.0000%	0.6575%	0.0006%
过去一年	2.6893%	0.0012%	1.3000%	0.0000%	1.3893%	0.0012%
过去三年	11.2754%	0.0026%	3.9000%	0.0000%	7.3754%	0.0026%
过去五年	19.7421%	0.0037%	7.3366%	0.0009%	12.4055%	0.0028%
自基金合同生效起至今	53.8807%	0.0053%	29.6630%	0.0021%	24.2177%	0.0032%

兴全货币 B

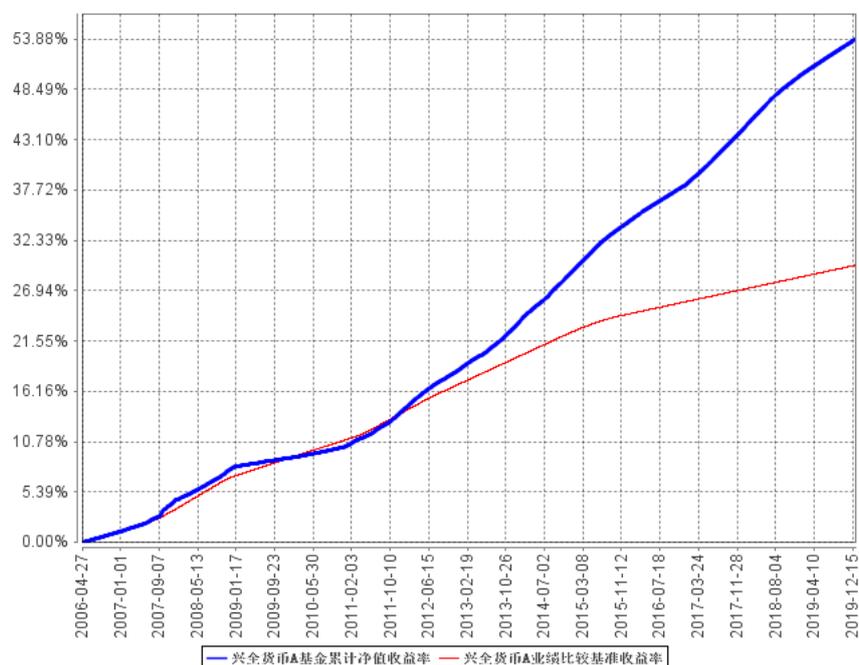
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7250%	0.0006%	0.3277%	0.0000%	0.3973%	0.0006%
过去六个月	1.4353%	0.0006%	0.6553%	0.0000%	0.7800%	0.0006%
过去一年	2.9360%	0.0012%	1.3000%	0.0000%	1.6360%	0.0012%
自基金合同生效起至今	10.9188%	0.0026%	3.5652%	0.0000%	7.3536%	0.0026%

注：1、本基金业绩比较基准为税后 6 个月银行定期存款利率，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴全基金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

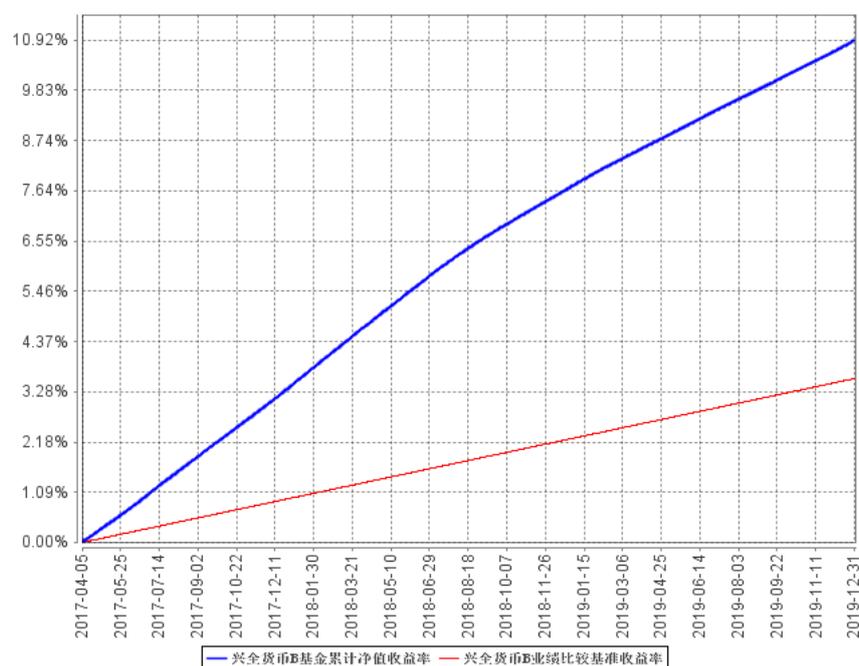
2、本基金于 2017 年 3 月 31 日召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于修改兴全货币市场证券投资基金费率、增设 B 类份额等有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会决议，管理人决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额，B 类份额自 2017 年 4 月 5 日起始运作。详情请见管理人网站公告。

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

兴全货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全货币B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。

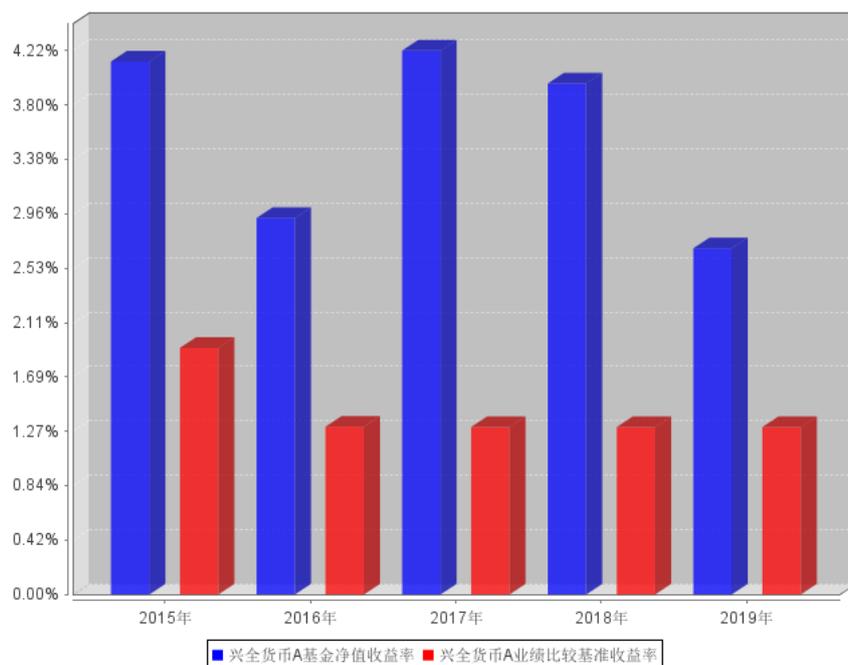
2、按照《兴全货币市场证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2006 年 4 月 27 日至 2006 年 10 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3、本基金于 2017 年 3 月 31 日召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于修改兴全货币

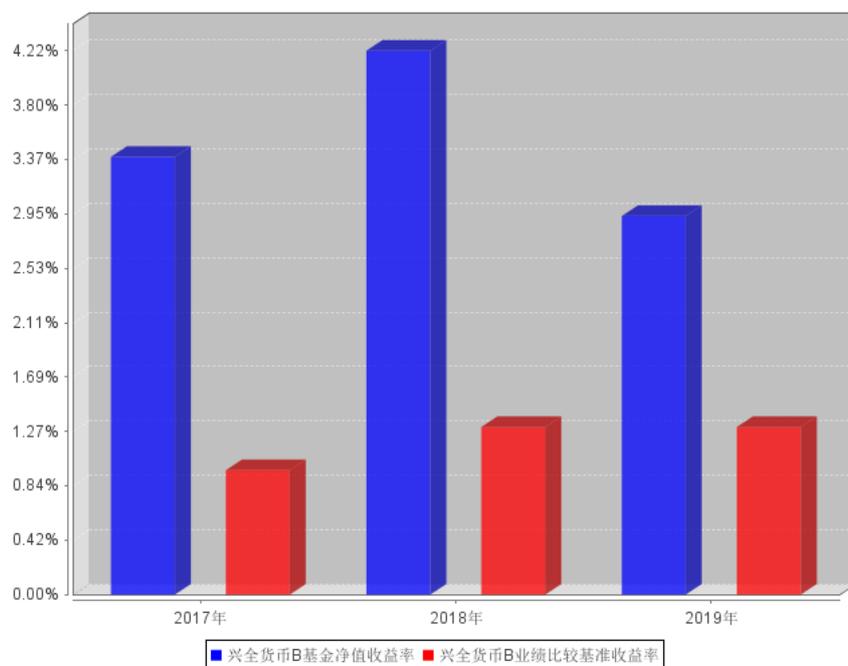
市场证券投资基金费率、增设 B 类份额等有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会决议，管理人决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额，B 类份额自 2017 年 4 月 5 日起始运作。详情请见管理人网站公告。

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

兴全货币A过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



兴全货币B过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2017 年 3 月 31 日召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于修改兴全货币市场证券投资基金费率、增设 B 类份额等有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会决议，管理人

决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额，B 类份额自 2017 年 4 月 5 日起始运作。详情请见管理人网站公告。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

兴全货币 A					
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	124,509,323.39	7,155,907.75	-10,097,420.01	121,567,811.13	
2018	302,220,808.18	20,567,299.59	-5,812,218.07	316,975,889.70	
2017	219,774,778.24	11,018,838.73	13,406,634.60	244,200,251.57	
合计	646,504,909.81	38,742,046.07	-2,503,003.48	682,743,952.40	

单位：人民币元

兴全货币 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
2019	823,955,755.52	47,182,264.68	26,983,307.27	898,121,327.47	
2018	711,564,039.10	25,886,273.14	-3,011,226.84	734,439,085.40	
2017	414,921,347.61	1,013,445.21	45,806,945.74	461,741,738.56	
合计	1,950,441,142.23	74,081,983.03	69,779,026.17	2,094,302,151.43	

## § 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、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		
谢芝兰	本基金基金经理	2016年4月22日	-	7年	经济学硕士。历任信诚基金管理有限公司交易员，兴全

					基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。
邓娟	本基金、兴全添利宝货币市场证券投资基金基金经理	2019年6月17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。
季伟杰	本基金基金经理助理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理助理	2017年6月23日	2019年6月25日	4年	金融学博士，历任天津银行股份有限公司任博士后研究，中信建投证券研究发展部宏观债券团队债券分析师，兴全基金管理有限公司固定收益部研究员。

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴全基金管理有限公司公平交易制度》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年政策托底经济意愿较强，但政策底线仍坚守，房地产市场政策未出现松动，货币政策灵活应对，并未出现大水漫灌，积极财政政策也受到宏观杠杆率制约，加上海外经济承压以及贸易摩擦反复，出口对经济增长贡献减弱，国内经济表现为上行动力不足，下行亦有底。猪瘟对通胀的影响上半年虽有预期，但下半年才体现在猪价以及通胀数据上，在中央通过大量投放储备肉增加猪肉供给的情况下，猪价稳住，通胀担忧减弱，对市场情绪仅出现短暂扰动。中美贸易摩擦反反复复，直至年底最终签订第一阶段协议，整个事件虽对风险偏好有一定影响，但随着时间拉长，市场已慢慢淡化，对市场的扰动已不如去年。全年债市呈现低位震荡行情，整体仍受经济基本面主导，而事件性冲击加大波动幅度。货币政策全年根据经济基本面相机抉择，一季度各项数据超预期好，政策二季度进入观察期，货币政策边际收紧，但仍旧充裕，资金面波动加大，债市震荡向上，期限利差走扩。5 月包商事件爆发，同业负债刚兑信仰打破，同业存款存单信用利差拉开，中小银行负债成本上升，出于维稳防范系统性金融风险发生，货币政策边际转松，金融系统总量流动性充裕，但流动性分层及结构性紧张仍未缓解。在一些列数据表现低于预期的情况下，三季度初央行重启降准，在流动性充裕情况下，资产荒现象重现，资质下沉策略使得信用利差进一步压缩至历史低位，尤其是之前市场较规避的民企、地产及低评级城投下行幅度较大。四季度通胀扰动下收益率出现短暂大幅上行，但在一系列措施保证供给控制猪价的情况下，通胀担忧很快缓解。为降低实体经济融资成本，疏通政策利率向贷款利率的传导，央行将贷款基准利率调整

为 LPR，且超预期下调了 OMO、MLF 利率，债券收益率又重回至接近年内低点。年底在摊余成本债基大量募集成立，集中建仓冲击下，中短端下行幅度较大，期限利差走扩。报告期内，本基金规模大幅增长，在货币政策保持宽松的环境下，投资策略上保持一定杠杆、久期，资产选择上绝对收益率及流动性并重。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期兴全货币 A 的基金份额净值收益率为 2.6893%，本报告期兴全货币 B 的基金份额净值收益率为 2.9360%，同期业绩比较基准收益率为 1.3000%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，前期托底经济政策延续，且有更进一步积极的倾向，地方债发行较去年进一步提前，海外经济体有边际改善迹象，贸易摩擦第一阶段协议签订后，进一步会谈可期。目前最大的不确定性在于突发新冠疫情对经济的影响，但从当前政策及会议讲话等来看，对经济负面影响的忍耐度较低，对冲政策也在逐步出台，包括要求有序复工，对中小微企业的资金支持，赤字率可能提升，地产政策松动也初现端倪等，为稳定预期，节后央行大量投放资金并下调政策利率。目前债市收益率绝对位置已接近 2016 年低点，短端已经较 2016 年更低，信用利差也处于历史低点，对疫情给经济带来的负面冲击已有较充分预期，在一系列保经济增速的政策效应下，应警惕超预期情形出现。

#### 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》、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本基金自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按月结转到份额持有人的基金账户。本报告期内，本基金本报告期内向 A 类基金基金份额持有人分配利润 121,567,811.13 元，向 B 类基金基金份额持有人分配利润 898,121,327.47 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 P00678 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了兴全货币市场证券投资基金的财务报表，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，公允反映了兴全货币市场证券投资基金 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，我们独立于兴全货币市场证券投资基金，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>兴全货币基金管理人兴全基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全货币基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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货币市场证券投资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货币市场证券投资基金、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货币市场证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能导致对兴全货币市场证券投资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</p>

	<p>致兴全货币市场证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 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：兴全货币市场证券投资基金

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	16,487,638,971.03	7,076,680,774.97
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	17,475,857,404.47	15,340,991,611.78
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		17,475,857,404.47	15,340,991,611.78
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,851,451,027.17	7,741,559,612.32
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	175,026,234.06	133,865,156.64
应收股利		-	-
应收申购款		77,925,243.57	88,186,739.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		42,067,898,880.30	30,381,283,895.49
<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		3,369,493,401.38	3,645,390,571.89
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		800,725.62	399,868.55
应付管理人报酬		6,541,143.37	4,415,921.63
应付托管费		1,816,984.30	1,226,644.90
应付销售服务费		1,153,474.41	1,705,078.05
应付交易费用	7.4.7.7	632,258.85	481,791.59
应交税费		66,428.74	188,162.54
应付利息		660,917.28	2,350,198.51

应付利润		70,810,590.94	53,924,703.68
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	186,882.51	139,783.55
负债合计		3,452,162,807.40	3,710,222,724.89
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	38,615,736,072.90	26,671,061,170.60
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		38,615,736,072.90	26,671,061,170.60
负债和所有者权益总计		42,067,898,880.30	30,381,283,895.49

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，兴全货币 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,668,155,326.05 份；兴全货币 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 34,947,580,746.85 份。兴全货币份额总额合计为 38,615,736,072.90 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

本报告期：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 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
<b>一、收入</b>		1,204,588,699.24	1,206,308,964.27
1.利息收入		1,205,820,270.83	1,188,254,050.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	336,709,000.81	451,739,587.35
债券利息收入		577,528,962.82	466,162,585.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		291,582,307.20	270,351,877.72
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,231,571.59	17,998,034.79
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	-1,231,571.59	17,998,034.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	56,878.53

列)			
<b>减：二、费用</b>		184,899,560.64	154,893,989.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	64,329,331.62	46,815,035.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	17,869,258.77	13,004,176.63
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	14,503,429.64	22,042,970.53
4. 交易费用	7.4.7.19	2,635.34	1,249.75
5. 利息支出		87,695,482.20	72,552,852.35
其中：卖出回购金融资产支出		87,695,482.20	72,552,852.35
6. 税金及附加		196,838.07	228,541.07
7. 其他费用	7.4.7.20	302,585.00	249,163.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,019,689,138.60	1,051,414,975.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,019,689,138.60	1,051,414,975.10

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全货币市场证券投资基金

本报告期：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）	26,671,061,170.60	-	26,671,061,170.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,019,689,138.60	1,019,689,138.60
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）	11,944,674,902.30	-	11,944,674,902.30
其中：1. 基金申购款	87,662,332,702.51	-	87,662,332,702.51
2. 基金赎回款	-75,717,657,800.21	-	-75,717,657,800.21
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）	-	-1,019,689,138.60	-1,019,689,138.60
五、期末所有者权益（基金净值）	38,615,736,072.90	-	38,615,736,072.90

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）	23,934,269,965.49	-	23,934,269,965.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,051,414,975.10	1,051,414,975.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,736,791,205.11	-	2,736,791,205.11
其中：1. 基金申购款	66,312,629,628.46	-	66,312,629,628.46
2. 基金赎回款	-63,575,838,423.35	-	-63,575,838,423.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,051,414,975.10	-1,051,414,975.10
五、期末所有者权益（基金净值）	26,671,061,170.60	-	26,671,061,170.60

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

兴全货币市场证券投资基金(原名兴业货币市场证券投资基金)(以下简称“本基金”)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》、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》(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[2006]49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1,729,582,293.12份,经安永大华会计师事务所验证。基金合同于2006年4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。本基金于2011年1月1日起更名为兴全货币市场证券投资基金。

根据兴全货币市场证券投资基金基金份额持有人大会于2017年3月31日表决通过的《关于修改兴全货币市场证券投资基金费率、增设B类份额等有关事项的议案》,自2017年3月31日起,

兴全基金管理有限公司对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（原来的基金份额，代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额。本基金对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。

本基金投资范围为以下金融工具：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行存款、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、短期融资券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金的业绩比较基准为 6 个月银行定期存款利率(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 0.18% 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资产净值的一定比例逐日计提。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；

(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) “每日分配、按月支付”。本基金的基金份额采用人民币 1.00 元的固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按月结转到投资者基金账户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元；基金投资当期亏损时，相应调减持有人持有份额，基金份额净值始终为 1.00 元；

(2) 本基金根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配到投资者收益账户。每月累计收益只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式结转为相应的基金份额，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则将相应缩减投资者基金份额。若投资者赎回时，收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除；

(3) 本基金每月集中结转当前累计收益，收益结转时以截尾的方式保留小数点后两位。因截尾形成的余额归入基金财产，参与第二个工作日的分配；

(4) 本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 当日申购的基金份额应当自下一个交易日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起不享有基金的分配权益；

(6) 在符合相关法律、法规及规范性文件的规定，并且不影响投资者利益情况下，经与基金托管人协商一致并得到批准后，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过；

(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	27,638,971.03	26,680,774.97
定期存款	16,460,000,000.00	7,050,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	400,000,000.00
存款期限1-3个月	1,660,000,000.00	950,000,000.00
存款期限3个月以上	14,800,000,000.00	5,700,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	16,487,638,971.03	7,076,680,774.97

### 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 交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	17,475,857,404.47	17,499,174,000.00	23,316,595.53	0.0604%
	合计	17,475,857,404.47	17,499,174,000.00	23,316,595.53	0.0604%
	资产支持证券	-	-	-	0.0000%
	合计	17,475,857,404.47	17,499,174,000.00	23,316,595.53	0.0604%
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	-	-	-	-
	银行间市场	15,340,991,611.78	15,360,180,000.00	19,188,388.22	0.0719%
	合计	15,340,991,611.78	15,360,180,000.00	19,188,388.22	0.0719%
	资产支持证券	-	-	-	0.0000%
	合计	15,340,991,611.78	15,360,180,000.00	19,188,388.22	0.0719%

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	-	-
银行间市场	7,851,451,027.17	-
合计	7,851,451,027.17	-
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	-	-
银行间市场	7,741,559,612.32	-
合计	7,741,559,612.32	-

**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	36,351.32	32,006.94
应收定期存款利息	116,514,092.92	31,359,749.37
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	43,727,059.79	80,023,876.72
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	14,748,730.03	22,447,201.48
应收申购款利息	-	2,322.13
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	175,026,234.06	133,865,156.64

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 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	632,258.85	481,791.59
合计	632,258.85	481,791.59

**7.4.7.8 其他负债**

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,882.51	783.55
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	-	-

应付转换费	-	-
审计师费	55,000.00	60,000.00
账户服务费	4,500.00	4,500.00
上清所账户服务费	4,500.00	4,500.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
合计	186,882.51	139,783.55

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全货币 A		
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	6,872,870,200.14	6,872,870,200.14
本期申购	9,316,566,488.24	9,316,566,488.24
本期赎回(以“-”号填列)	-12,521,281,362.33	-12,521,281,362.33
- 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	3,668,155,326.05	3,668,155,326.05

金额单位：人民币元

兴全货币 B		
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	19,798,190,970.46	19,798,190,970.46
本期申购	78,345,766,214.27	78,345,766,214.27
本期赎回(以“-”号填列)	-63,196,376,437.88	-63,196,376,437.88
- 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	34,947,580,746.85	34,947,580,746.85

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全货币 A			
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	121,567,811.13	-	121,567,811.13
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	-121,567,811.13	-	-121,567,811.13
本期末	-	-	-

单位：人民币元

兴全货币 B			
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	898,121,327.47	-	898,121,327.47
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	-898,121,327.47	-	-898,121,327.47
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	487,726.08	331,460.24
定期存款利息收入	336,129,538.02	451,007,613.28
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	60.00
其他	91,736.71	400,453.83
合计	336,709,000.81	451,739,587.35

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未进行股票买卖交易。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 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	-1,231,571.59	17,998,034.79
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	-1,231,571.59	17,998,034.79

**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	122,212,321,954.85	87,792,232,914.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	121,772,045,050.37	87,246,414,772.98
减：应收利息总额	441,508,476.07	527,820,107.13
买卖债券差价收入	-1,231,571.59	17,998,034.79

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

本基金本报告期末及上年度末均不存在公允价值变动收益。

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 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
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	56,878.53
合计	-	56,878.53

**7.4.7.19 交易费用**

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
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	2,635.34	1,249.75
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,635.34	1,249.75

**7.4.7.20 其他费用**

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
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,400.00	719.56

银行汇划费	-	-
交易费用	-	-
账户服务费	36,000.00	36,300.00
银行费用	90,185.00	82,144.00
合计	302,585.00	249,163.56

#### 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、基金销售机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	64,329,331.62	46,815,035.28
其中：支付销售机构的客户维护费	10,837,983.79	9,989,342.49

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.18% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.18%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 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	17,869,258.77	13,004,176.63

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	兴全货币 A	兴全货币 B	合计
兴全基金管理有限公司	796,171.76	2,343,176.70	3,139,348.46
兴业证券	534,839.44	33,101.07	567,940.51
兴业银行	220,854.58	15,275.15	236,129.73
合计	1,551,865.78	2,391,552.92	3,943,418.70
获得销售服务费的各关联方名称	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		
	兴全货币 A	兴全货币 B	合计
兴全基金管理有限公司	1,153,234.06	1,533,214.08	2,686,448.14
兴业证券	712,271.13	19,577.58	731,848.71
兴业银行	302,676.56	10,342.41	313,018.97
合计	2,168,181.75	1,563,134.07	3,731,315.82

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

A 级份额：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

B 级份额：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数

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

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日					
	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	1,170,633,400.00	-	-	-	3,671,230,000.00	420,072.47
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	692,136,700.00	-	-	-	100,000,000.00	7,808.22

#### 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	兴全货币 A	兴全货币 B
报告期初持有的基金份额	524,084.38	-
报告期间申购/买入总份额	-	960,146,332.36
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	524,084.38	598,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	362,146,332.36
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.9378%

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	兴全货币 A	兴全货币 B
报告期初持有的基金份额	-	552,568,869.81
报告期间申购/买入总份额	524,084.38	464,589,779.17
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	1,017,158,648.98
报告期末持有的基金份额	524,084.38	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0020%	-

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

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

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

兴全货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 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
兴全睿众	59,415,776.44	0.1539%	56,367,558.10	0.2113%
兴业银行	11,893,781,482.67	30.8003%	6,636,260,778.57	24.8819%
兴业证券	211,950,058.30	0.5489%	205,862,351.45	0.7719%

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	527,638,971.03	3,261,059.20	26,680,774.97	9,243,960.24

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

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 1,200,000,000.00 元，估值总额 1,183,452,279.03 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

兴全货币 A

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
124,509,323.39	7,155,907.75	-10,097,420.01	121,567,811.13	-

兴全货币 B

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
823,955,755.52	47,182,264.68	26,983,307.27	898,121,327.47	-

## 7.4.12 期末（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

本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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人民币 3,369,493,401.38 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
100204	10 国开 04	2020 年 1 月 2 日	99.90	3,500,000	349,666,894.93
111910100	19 兴业银行 CD100	2020 年 1 月 2 日	99.49	1,200,000	119,383,110.64
111910143	19 兴业银行 CD143	2020 年 1 月 2 日	99.27	150,000	14,889,924.60
111910518	19 兴业银行 CD518	2020 年 1 月 2 日	97.05	2,750,000	266,881,149.24
111911288	19 平安银行 CD288	2020 年 1 月 2 日	99.32	1,000,000	99,317,973.38
111915466	19 民生银行 CD466	2020 年 1 月 2 日	99.24	3,000,000	297,712,000.95
150203	15 国开 03	2020 年 1 月 2 日	100.10	700,000	70,073,467.60
150208	15 国开 08	2020 年 1 月 2 日	100.39	8,100,000	813,171,709.60
180202	18 国开 02	2020 年 1 月 2 日	100.19	400,000	40,076,421.64
190206	19 国开 06	2020 年 1 月 2 日	99.99	1,400,000	139,992,534.78
190402	19 农发 02	2020 年 1 月 2 日	99.96	4,600,000	459,810,666.00
199948	19 贴现国债 48	2020 年 1 月 2 日	99.07	500,000	49,533,867.57
111921460	19 渤海银行 CD460	2020 年 1 月 3 日	98.44	3,000,000	295,334,631.19
111921465	19 渤海银	2020 年 1 月 3 日	98.55	2,750,000	271,008,764.60

	行 CD465	日			
111921482	19 渤海银行 CD482	2020 年 1 月 3 日	98.50	2,700,000	265,955,578.52
合计				35,750,000	3,552,808,695.24

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场正回购抵押债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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	0.00	342,802,178.51
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	190,173,949.92	971,474,612.55
合计	190,173,949.92	1,314,276,791.06

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	-	343,848,411.56
AAA 以下	-	10,131,150.83
未评级	-	0.00
合计	-	353,979,562.39

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	12,940,156,256.45	11,827,828,164.29
AAA 以下	2,423,201,635.98	492,481,773.41
未评级	-	-
合计	15,363,357,892.43	12,320,309,937.70

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现

周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.3.1 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 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	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,527,638,971.03	9,360,000,000.00	5,600,000,000.00	-	-	-	-16,487,638,971.03
交易性金融资产	548,859,289.79	6,566,121,276.67	10,360,876,838.01	-	-	-	-17,475,857,404.47
买入返售金融资产	6,268,942,213.41	1,582,508,813.76	-	-	-	-	-7,851,451,027.17
应收利息	-	-	-	-	-	-175,026,234.06	175,026,234.06
应收申购款	-	-	-	-	-	-77,925,243.57	77,925,243.57
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,345,440,474.23	17,508,630,090.43	15,960,876,838.01	-	-	-252,951,477.63	42,067,898,880.30
负债							
卖出回购金融资产款	3,369,493,401.38	-	-	-	-	-	-3,369,493,401.38
应付赎回款	-	-	-	-	-	800,725.62	800,725.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,541,143.37	6,541,143.37
应付托管费	-	-	-	-	-	1,816,984.30	1,816,984.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,153,474.41	1,153,474.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	632,258.85	632,258.85
应付利息	-	-	-	-	-	660,917.28	660,917.28
应交税费	-	-	-	-	-	66,428.74	66,428.74
应付利润	-	-	-	-	-	70,810,590.94	70,810,590.94
其他负债	-	-	-	-	-	186,882.51	186,882.51
负债总计	3,369,493,401.38	-	-	-	-	-82,669,406.02	3,452,162,807.40
利率敏感度缺口	4,975,947,072.85	17,508,630,090.43	15,960,876,838.01	-	-	-170,282,071.61	38,615,736,072.90
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	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	826,680,774.97	2,650,000,000.00	3,600,000,000.00	-	-	-	-7,076,680,774.97
交易性金融资产	410,404,857.70	8,322,203,520.48	6,608,383,233.60	-	-	-	-15,340,991,611.78

买入返售金融资产	6,390,223,265.32	1,351,336,347.00	-	-	-	-	7,741,559,612.32
应收利息	-	-	-	-	-	-133,865,156.64	133,865,156.64
应收申购款	14,303,180.20	-	-	-	-	73,883,559.58	88,186,739.78
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,641,612,078.19	12,323,539,867.48	10,208,383,233.60	-	-	-207,748,716.22	30,381,283,895.49
负债							
卖出回购金融资产款	3,645,390,571.89	-	-	-	-	-	3,645,390,571.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	399,868.55	399,868.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,415,921.63	4,415,921.63
应付托管费	-	-	-	-	-	1,226,644.90	1,226,644.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,705,078.05	1,705,078.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	481,791.59	481,791.59
应付利息	-	-	-	-	-	2,350,198.51	2,350,198.51
应交税费	-	-	-	-	-	188,162.54	188,162.54
应付利润	-	-	-	-	-	53,924,703.68	53,924,703.68
其他负债	-	-	-	-	-	139,783.55	139,783.55
负债总计	3,645,390,571.89	-	-	-	-	64,832,153.00	3,710,222,724.89
利率敏感度缺口	3,996,221,506.30	12,323,539,867.48	10,208,383,233.60	-	-	-142,916,563.22	26,671,061,170.60

#### 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)
	市场利率下降1%	60,259,032.51	43,562,343.55
	市场利率上升1%	-59,724,328.93	-43,242,150.62

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

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金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 17,475,857,404.47 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 15,340,991,611.78 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

## § 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	17,475,857,404.47	41.54
	其中:债券	17,475,857,404.47	41.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,851,451,027.17	18.66
	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	16,487,638,971.03	39.19
4	其他各项资产	252,951,477.63	0.60
5	合计	42,067,898,880.30	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.28	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,369,493,401.38	8.73
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	96
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	52

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过 180 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	21.22	8.73
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	29.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	35.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	108.28	8.73

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	49,533,867.57	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,872,791,694.55	4.85
	其中：政策性金融债	1,872,791,694.55	4.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	190,173,949.92	0.49
6	中期票据	-	-
7	同业存单	15,363,357,892.43	39.79
8	其他	-	-
9	合计	17,475,857,404.47	45.26
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	150208	15 国开 08	8,100,000	813,171,709.60	2.11
2	190402	19 农发 02	4,600,000	459,810,666.00	1.19
3	111916382	19 上海银行 CD382	4,000,000	399,244,327.23	1.03
4	111911256	19 平安银行 CD256	4,000,000	398,090,224.08	1.03
5	111910103	19 兴业银行 CD103	4,000,000	397,427,695.13	1.03
6	111911288	19 平安银行 CD288	4,000,000	397,271,893.51	1.03
7	111910518	19 兴业银行 CD518	4,000,000	388,190,762.53	1.01
8	100204	10 国开 04	3,500,000	349,666,894.93	0.91
9	111910100	19 兴业银行 CD100	3,500,000	348,200,739.38	0.90
10	111915466	19 民生银行 CD466	3,500,000	347,330,667.77	0.90

**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	0.1136%
报告期内偏离度的最低值	0.0175%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0501%

**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

本报告期内无需说明的证券投资决策程序，报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	175,026,234.06
4	应收申购款	77,925,243.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	252,951,477.63

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴全货币A	559,807	6,552.54	181,088,032.90	4.94%	3,487,067,293.15	95.06%
兴全货币B	253	138,132,730.22	34,729,523,035.69	99.38%	218,057,711.16	0.62%
合计	560,060	68,949.28	34,910,611,068.59	90.41%	3,705,125,004.31	9.59%

### 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	1,697,665,731.35	4.40%
2	银行类机构	855,413,873.71	2.22%
3	银行类机构	607,165,525.18	1.57%
4	其他机构	529,125,899.70	1.37%
5	银行类机构	515,886,077.18	1.34%
6	银行类机构	515,886,077.18	1.34%
7	银行类机构	515,508,287.30	1.33%
8	银行类机构	515,508,287.30	1.33%
9	银行类机构	515,508,287.30	1.33%
10	券商类机构	515,181,539.14	1.33%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全货币 A	4,438,539.33	0.1210%
	兴全货币 B	14,275,086.33	0.0408%
	合计	18,713,625.66	0.0485%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴全货币 A	>100
	兴全货币 B	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全货币 A	0~10
	兴全货币 B	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	兴全货币 A	兴全货币 B
基金合同生效日（2006 年 4 月 27 日）基金份额总额	1,729,582,293.12	-
本报告期期初基金份额总额	6,872,870,200.14	19,798,190,970.46
本报告期基金总申购份额	9,316,566,488.24	78,345,766,214.27
减:本报告期基金总赎回份额	12,521,281,362.33	63,196,376,437.88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	3,668,155,326.05	34,947,580,746.85

注：1、总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2、本基金于 2017 年 3 月 31 日召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于修改兴全货币市场证券投资基金费率、增设 B 类份额等有关事项的议案》，根据基金份额持有人大会决议，管理人决定自 2017 年 3 月 31 日起对兴全货币市场证券投资基金实施基金份额分类，划分为 A 类（代码：340005）、B 类（代码：004417）两类基金份额，B 类份额自 2017 年 4 月 5 日起始运作。详情请见管理人网站公告。

## § 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

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）变更为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金自 2019 年起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	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能

力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 1 月 1 日
2	关于兴全货币市场基金暂停接受五千万以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 1 月 2 日
3	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 1 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 1 月 10 日
4	关于兴全货币市场基金“春节”假期前暂停接受一百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 1 月 31 日
5	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 2 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 2 月 11 日
6	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 3 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 3 月 11 日
7	关于兴全货币市场基金暂停接受三亿元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 3 月 15 日
8	兴全添利宝货币市场基金新增转换基金的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 3 月 15 日
9	关于兴全货币市场基金“清明节”假期前暂停接受申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 4 月 1 日
10	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 4 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 4 月 10 日
11	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 4 月 12 日

		站	日
12	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 5 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 5 月 10 日
13	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 6 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 6 月 10 日
14	关于兴全货币市场证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 6 月 18 日
15	关于兴全货币市场基金基金经理休假由他人代为履行职责的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 6 月 18 日
16	关于兴全货币市场基金暂停接受五亿元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 6 月 18 日
17	关于增加兴证期货公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 6 月 21 日
18	关于兴全货币市场基金暂停接受二亿元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 6 月 27 日
19	旗下各基金 2019 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 7 月 1 日
20	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 7 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 7 月 10 日
21	关于兴全货币市场基金暂停接受五亿元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 8 月 8 日
22	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 8 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 8 月 12 日
23	关于增加东海证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 8 月 12 日
24	关于调整旗下部分基金直销柜台申购起点金额的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 8 月 28 日
25	关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 9 月 2 日
26	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019 年第 9 号）	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 9 月 10 日
27	关于增加西部证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 9 月 19 日
28	关于增加中国中投证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 9 月 19 日
29	关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分基金销	中国证券报、指定互联网网站	2019 年 9 月 24 日

	售机构的公告		
30	关于兴全货币市场基金“国庆节”假期前暂停接受申购和转换转入申请的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年9月27日
31	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019年第10号）	中国证券报、指定互联网网站	2019年10月10日
32	关于调整旗下部分基金最低申购、追加申购、定期定额投资金额及最低赎回、转换转出、持有份额的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年10月18日
33	关于增加中国国际金融股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年10月21日
34	关于兴全货币市场基金基金经理恢复履行职责的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年10月24日
35	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019年第11号）	中国证券报、指定互联网网站	2019年11月11日
36	关于增加我司部分基金销售机构及调整旗下基金在部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年11月14日
37	关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年11月18日
38	关于调整网上直销基金转换、赎回申购优惠费率的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年12月6日
39	兴全货币市场证券投资基金收益支付公告（2019年第12号）	中国证券报、指定互联网网站	2019年12月10日
40	关于兴全货币基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、指定互联网网站	2019年12月20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。

3、该投资者持有份额为兴全货币 B，分级基金按总份额占比计算。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全货币市场证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全货币市场证券投资基金更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.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