兴全添利宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30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8月28日

§1重要提示

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。本半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8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	兴全添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	000575
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年2月27日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	55,702,782,405.08份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2基金产品说明

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

2.3基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	yangwd@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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金半年度报告备置地点	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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	1,197,414,617.89
本期利润	1,197,414,617.89
本期净值收益率	2.1354%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-
期末基金资产净值	55,702,782,405.08
期末基金份额净值	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。

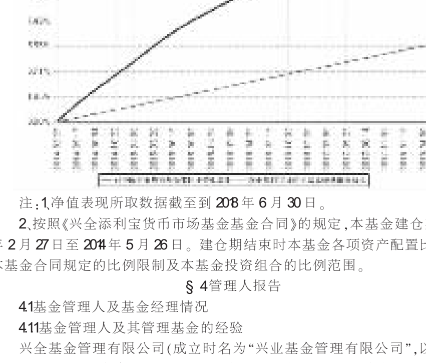
3.2基金净值表现

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

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	0.3428%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.2318%	0.0007%
过去三个月	1.0446%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.7080%	0.0008%
过去六个月	2.1354%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	1.4659%	0.0008%
过去一年	4.2307%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	2.8807%	0.0008%
过去三年	11.0823%	0.0019%	4.0537%	0.0000%	7.0286%	0.0019%
自基金合同生效起至今	18.5422%	0.0026%	5.8623%	0.0000%	12.6799%	0.0026%

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

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



注:1、净值表现所取数据截至到2018年6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。

§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12亿元,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15亿元人民币,其中两股东出资比例不变。2016年12月28日,因公司发展需要,公司名称变更为"兴全基金管理有限公司"。

截止2018年6月30日,公司旗下管理着二十二只基金,分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
翟秀华	本基金、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全兴泰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基金经理	2016年3月17日	-	9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。
王健	本基金基金经理助理、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理、兴全天添益货币市场基金基金经理助理	2017年4月27日	-	4年	经济学硕士,2014年加入兴全基金管理有限公司,历任固定收益部研究员。

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遵规守信情况的说明

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

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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、考察是否存在非公平的因素。

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,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不存在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

经历了1年零3个月的熊市之后,10Y国开触底回升,到2018年中,从5.1的高位一路回落到4.25附近,为债券投资人带来了可观的收益。纵观上半年,外围市场不断超出预期,欧美经济数据表现亮眼,联储加息节奏继续,债券市场调整明显;国内债券市场呈现了明显的结构性行情,在刚兑打破的预期下,信用利差不断拉大,实质性违约主体数量和金额都有所放大。市场方面,在严监管、去通道的政策下,国内政策组合从紧货币、宽信用逐渐演变为稳货币、紧信用,金融市场流动性逐渐好转,短端大幅下行;长端则受制于配置力量不足和理财规模收缩等,下行幅度略弱于短端,曲线由平坦变为陡峭,期限利差有所放大。运作期内,受到短端利率下行的带动,货币基金整体收益有所下行。本基金基于对资金供需力量发生逆转的判断下,结合商业银行负债端的调整,采取了哑铃型资产配置策略,在充裕流动性的基础上适度拉长久期,充分享受了短端收益下行带来的超额收益,为投资人创造了超越基准的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为2.1354%,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

展望下半年,社融收缩带来的影响将逐渐反应在经济基本面中,实体经济下行预期渐浓。在防控系统风险的思路下,宏观政策方面开始微调,重心从去杠杆开始向稳杠杆、稳增长转移;预计货币政策依旧延续中性偏宽松,金融体系将逐渐加大对实体经济的支持力度,由紧信用向稳信用转变,债券市场信用风险有所降低,金融市场避险情绪缓和。前期短端大幅下滑后,继续下行空间有限,预计货币基金绝对收益水平将稳中有降。考虑到货币基金的低风险、高流动性的特征,这一略微下降的收益水平对持有人来说仍然是较为可观的。

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有3年以上相关工作经历,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。本报告期内,本基金本报告期内向基金份额持有人分配利润1,197,414,617.89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

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托管人对本半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半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:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		15,264,637,178.25	17,479,712,784.70
结算备付金		68,827,632.00	25,648,490.90
存出保证金		9.34	-
交易性金融资产		32,091,674,225.70	24,766,344,497.42
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		32,091,674,225.70	24,721,398,307.96
资产支持证券投资		-	44,946,189.46
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		15,446,052,856.91	7,987,086,188.34
应收证券清算款		-	-
应收利息		301,556,001.26	276,817,276.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		63,172,747,903.46	50,535,609,238.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		3,383,974,248.69	4,343,815,094.70
应付证券清算款		4,055,149,068.77	1,728,200,000.00
应付赎回款		-	150,000,000.00
应付管理人报酬		13,452,101.07	11,281,778.96
应付托管费		2,491,129.81	2,089,218.33
应付销售服务费		12,455,649.13	10,446,091.58
应付交易费用		633,887.25	620,603.79
应交税费		629,048.13	-
应付利息		1,029,541.17	2,766,511.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		150,824.36	247,000.00
负债合计		7,469,965,498.38	6,249,466,298.86
所有者权益:			
实收基金		55,702,782,405.08	44,286,142,939.31
未分配利润		-	-
所有者权益合计		55,702,782,405.08	44,286,142,939.31
负债和所有者权益总计		63,172,747,903.46	50,535,609,238.17

注:报告截止日2018年6月30日,兴全添利宝货币基金份额净值1.0000元,基金份额总额55,702,782,405.08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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		1,413,330,866.32	959,622,620.45
1.利息收入		1,451,498,021.37	933,159,685.10
其中:存款利息收入		441,115,355.54	555,192,217.98
债券利息收入		719,464,301.03	332,035,932.03
资产支持证券利息收入		188,897.12	-
买入返售金融资产收入		290,729,467.68	45,931,535.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-38,477,863.47	26,462,935.35
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-38,484,296.76	26,462,935.35
资产支持证券投资收益		6,433.29	-
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)		310,708.42	-
减:二、费用		215,916,248.43	160,975,016.88
1. 管理人报酬		75,936,151.63	59,102,773.36
2. 托管费		14,062,250.23	10,944,958.10
3. 销售服务费		70,311,251.54	54,724,790.10
4. 交易费用		1,757.76	-
5. 利息支出		54,866,522.87	35,954,398.21
其中:卖出回购金融资产支出		54,866,522.87	35,954,398.21
6. 税金及附加		495,155.04	-
7. 其他费用		243,159.36	248,097.11
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,197,414,617.89	798,647,603.57
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,197,414,617.89	798,647,603.57

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:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	44,286,142,939.31	-	44,286,142,939.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,197,414,617.89	1,197,414,617.89
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)	11,416,639,465.77	-	11,416,639,465.77
其中:1.基金申购款	170,212,730,767.22	-	170,212,730,767.22
2.基金赎回款	-158,796,091,301.45	-	-158,796,091,301.45
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)	-	-1,197,414,617.89	-1,197,414,617.89
五、期末所有者权益(基金净值)	55,702,782,405.08	-	55,702,782,405.08

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	43,078,464,877.07	-	43,078,464,877.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	798,647,603.57	798,647,603.57
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)	4,262,115,589.96	-	4,262,115,589.96
其中:1.基金申购款	150,279,931,849.30	-	150,279,931,849.30
2.基金赎回款	-146,017,816,259.34	-	-146,017,816,259.34
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)	-	-798,647,603.57	-798,647,603.57
五、期末所有者权益(基金净值)	47,340,580,467.03	-	47,340,580,467.03

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:

兰荣　　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")系由基金管理人兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》(以下简称"基金合同")及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")以证监许可[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2018年6月30日的财务状况以及2018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[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。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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
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
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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

股票不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

6.4.8.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
兴业证券	-	-	142,509,359.09	100.00%

6.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	94,337,571,000.00	100.00%	48,271,653,000.00	100.00%

6.4.8.1.4权证交易

权证不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

6.4.8.1.5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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	75,936,151.63	59,102,773.36
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0.27%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.27%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,062,250.23	10,944,958.10

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。

6.4.8.2.3销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费
兴全基金管理有限公司	70,311,251.54
合计	70,311,251.54
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费
兴全基金管理有限公司	54,724,790.10
合计	54,724,790.10

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。

6.4.8.3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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
兴业银行	4,571,224,050.00	-	-	-	15,609,110,000.00	2,243,398.58

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
兴业银行	2,115,010,178.08	-	-	-	7,033,040,000.00	1,570,368.14

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
期初持有的基金份额	64,939,788.98	701,026,439.77
期间申购/买入总份额	825,235,866.07	703,803,317.82
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	662,600,000.00	701,000,000.00
期末持有的基金份额	227,575,655.05	703,829,757.59
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.4086%	1.4867%

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。

6.4.8.4.2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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	1,011,548,651.70	1.8160%	505,764,972.90	1.4200%
兴全睿众	6,674,916.46	0.0120%	35,385,402.64	0.0799%
兴业银行	7,762,606,309.55	13.9358%	5,634,522,568.45	12.7230%

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。

6.4.8.5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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,764,637,178.25	158,158,095.52	6,531,791,423.70	132,704,448.39

6.4.8.6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未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7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1,950,000,000.00元,估值总额1,928,625,000.00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。

6.4.9期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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。

6.4.9.2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。

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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3,383,974,248.69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
111783389	17河北银行CD080	2018年7月2日	99.46	440,000	43,762,400.00
140303	14进出03	2018年7月3日	101.02	1,000,000	101,020,000.00
160412	16农发12	2018年7月3日	99.17	500,000	49,585,000.00
180407	18农发07	2018年7月3日	100.16	600,000	60,096,000.00
120227	12国开27	2018年7月4日	100.41	600,000	60,246,000.00
140202	14国开02	2018年7月4日	101.09	400,000	40,436,000.00
120227	12国开27	2018年7月4日	100.41	300,000	30,123,000.00
160415	16农发15	2018年7月4日	99.53	1,800,000	179,154,000.00
111892536	18贵阳银行CD046	2018年7月4日	98.37	1,500,000	147,555,000.00
140202	14国开02	2018年7月4日	101.09	500,000	50,545,000.00
140303	14进出03	2018年7月4日	101.02	200,000	20,204,000.00
180207	18国开07	2018年7月4日	99.93	1,300,000	129,909,000.00
120208	12国开08	2018年7月5日	99.08	590,000	58,457,200.00
180207	18国开07	2018年7月5日	99.93	870,000	86,939,100.00
111809136	18浦发银行CD136	2018年7月5日	99.61	2,000,000	199,220,000.00
111810210	18兴业银行CD210	2018年7月5日	96.47	2,000,000	192,940,000.00
111810226	18兴业银行CD226	2018年7月5日	99.57	1,500,000	149,355,000.00
180404	18农发04	2018年7月2日	100.30	2,080,000	208,624,000.00
180404	18农发04	2018年7月2日	100.30	1,050,000	105,315,000.00
180201	18国开01	2018年7月2日	100.30	4,100,000	411,230,000.00
120208	12国开08	2018年7月2日	99.08	810,000	80,254,800.00
160202	16国开02	2018年7月2日	100.11	7,300,000	730,803,000.00
120208	12国开08	2018年7月2日	99.08	1,600,000	158,528,000.00
160301	16进出01	2018年7月2日	99.46	2,000,000	198,920,000.00
180404	18农发04	2018年7月2日	100.30	520,000	52,156,000.00
合计				35,560,000	3,545,377,500.00

6.4.9.3.2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。

6.4.10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	32,091,674,225.70	50.80
	其中:债券	32,091,674,225.70	50.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	15,446,052,856.91	24.45
	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	15,333,464,810.25	24.27
4	其他各项资产	301,556,010.60	0.48
5	合计	63,172,747,903.46	100.00

7.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		6.76
	其中:买断式回购融资		-
2	报告期末债券回购融资余额	3,383,974,248.69	6.08
	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。

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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

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	32.37	13.36
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	16.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	26.57	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	31.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.87	13.36

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

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	3,329,456,963.94	5.98
	其中:政策性金融债	3,329,456,963.94	5.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,669,102,866.67	8.38
6	中期票据	1,450,488,630.27	2.60
7	同业存单	22,642,625,764.82	40.65
8	其他	-	-
9	合计	32,091,674,225.70	57.61
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	160202	16国开02	7,300,000	729,848,305.92	1.31
2	111810263	18兴业银行CD263	7,000,000	694,143,846.59	1.25
3	111896207	18宁波银行CD074	6,000,000	597,385,761.21	1.07
4	111810296	18兴业银行CD296	6,000,000	594,247,330.32	1.07
5	180201	18国开01	5,500,000	549,816,271.27	0.99
6	180207	18国开07	5,200,000	517,614,238.98	0.93
7	111806164	18交通银行CD164	5,000,000	495,164,042.04	0.89
8	111818183	18华夏银行CD183	5,000,000	494,702,078.47	0.89
9	111812130	18北京银行CD130	5,000,000	485,312,581.58	0.87
10	111894372	18南京银行CD052	5,000,000	481,625,177.47	0.86

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2499%
报告期内偏离度的最低值	0.0463%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1323%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

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

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。

7.9投资组合报告附注

7.9.1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。

7.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

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	9.34
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	301,556,001.26
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	301,556,010.60

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
1,412,473	39,436.35	20,429,032,260.69	36.68%	35,273,750,144.39	63.32%

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	银行类机构	2,097,745,667.24	3.77
2	银行类机构	1,040,695,384.99	1.87
3	银行类机构	1,040,695,384.99	1.87
4	券商类机构	1,011,548,651.70	1.82
5	银行类机构	1,000,451,497.73	1.80
6	银行类机构	999,710,294.79	1.79
7	银行类机构	763,681,482.31	1.37
8	银行类机构	729,309,615.75	1.31
9	银行类机构	564,037,507.38	1.01
10	银行类机构	546,618,113.11	0.98

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	140,309,190.72	0.2519%

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的情况

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

§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	44,286,142,939.31
本报告期基金总申购份额	170,212,730,767.22
减:本报告期基金总赎回份额	158,796,091,301.45
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	55,702,782,405.08

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重大人事变动。 2018年3月21日公告,自2018年3月21日起傅鹏博先生不再担任副总经理职务。 2018年5月11日公告,自2018年5月11日起陈锦泉先生担任副总经理。 2018年6月14日公告,自2018年6月12日起,公司督察长由冯晓莲女士变更为杨卫东先生,杨卫东先生不再担任副总经理职务。 (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

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤会计师事务所(特殊普通合伙)。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
兴业证券	2	-	-	-	-	-

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	94,337,571,000.00	100.00%	-	-

10.8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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 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、"申购份额"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。

兴全基金管理有限公司

2018年8月28日