兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）

2019年第二季度报告

基金管理人：兴全基金管理有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
报告送出日期：2019年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全商业模式混合(LOF)
场内简称	兴全模式
基金主代码	163415
交易代码	163415
前端交易代码	163415
后端交易代码	163416
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年12月18日
报告期末基金份额总额	1,094,864,756.26份
投资目标	本基金以挖掘、筛选具有优秀商业模式的公司为主要投资策略，通过投资这类公司，力求获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	本基金为混合型基金，投资策略细分方资产配置策略，股票筛选策略，以及行业配置策略等，其中以"商业模式"优选为股票筛选策略。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年4月1日 - 2019年6月30日）
1.本期已实现收益	51,193,741.75
2.本期利润	61,336,613.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0611
4.期末基金资产净值	2,007,825,495.92
5.期末基金份额净值	1.834

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	2.80%	1.50%	-0.87%	1.22%	3.67%	0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长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2019年6月30日。

2、按照《兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为2012年12月18日至2013年6月17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投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔迁	本基金、兴全有机灵活配置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）基金经理	2018年7月10日	-	11年	工商管理硕士，历任兴全基金管理有限公司行业研究员、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理助理。

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

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

3、"证券从业年限"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、《兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，市场出现一定幅度调整。国内政策延续友好的态势，而国际问题方面则出现了一些波折，同时今年一季度市场整体涨幅较大，对基本面预期及估值均进行了一定幅度的乐观修正，在此背景下，市场的波动总体较前期有所加大。本基金报告期内仓位水平中性，重点在于结构的把握，贸易战因素难以把控，通过聚焦优选品种构建安全边际。总体，对于行业个股，中长期持仓的部分继续布局那些拉长周期角度基本面和估值具备投资性价比的优质公司，仍然以此作为核心底仓及跟踪的品种，同时在市场剧烈波动中，积极关注行业、模式及公司管理能力良好但前期由于受市场风格或情绪影响被边缘化的公司，关注其盈利和估值的匹配度和性价比。总体我们仍然坚持自下而上精选个股的策略，以长期的基本面为导向，适度结合中短期因素对组合做整体的平衡。本基金的操作仍然以为投资者创造中长期价值为宗旨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.834元；本报告期基金份额净值增长率为2.80%，业绩比较基准收益率为-0.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,684,604,044.34	83.33
	其中：股票	1,684,604,044.34	83.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	125,650,369.81	6.22
	其中：债券	125,650,369.81	6.22
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	207,254,801.35	10.25
8	其他资产	4,180,251.18	0.21
9	合计	2,021,689,466.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	31,988,076.25	1.59
C	制造业	1,037,131,923.69	51.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	211,584,754.10	10.54
G	交通运输、仓储和邮政业	6,347,124.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,806,824.04	7.06
J	金融业	145,841,890.77	7.26
K	房地产业	75,360,866.24	3.75
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	34,542,585.25	1.72
S	综合	-	-
	合计	1,684,604,044.34	83.90

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	601933	永辉超市	16,776,842	171,291,556.82	8.53
2	601318	中国平安	1,645,503	145,808,020.83	7.26
3	601012	隆基股份	5,953,739	137,590,908.29	6.85
4	600398	海澜之家	9,345,224	84,761,181.68	4.22
5	300271	华宇软件	4,401,449	82,995,531.00	4.13
6	600048	保利地产	5,906,024	75,360,866.24	3.75
7	002938	鹏鼎控股	2,403,231	70,558,862.16	3.51
8	603338	浙江鼎力	1,081,924	63,519,758.04	3.16
9	600519	贵州茅台	59,577	58,623,768.00	2.92
10	603707	健友股份	1,630,418	56,643,276.30	2.82

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	66,008,252.20	3.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,006,000.00	1.00
	其中：政策性金融债	20,006,000.00	1.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	39,636,117.61	1.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	125,650,369.81	6.26

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	019611	19国债01	481,630	48,124,469.60	2.40
2	180209	18国开09	200,000	20,006,000.00	1.00
3	019547	16国债19	195,110	17,883,782.60	0.89
4	110045	海澜转债	173,800	17,164,488.00	0.85
5	128032	双环转债	67,676	6,304,019.40	0.31

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	745,743.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,499,694.91
5	应收申购款	1,934,812.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,180,251.18

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110045	海澜转债	17,164,488.00	0.85
2	128032	双环转债	6,304,019.40	0.31
3	113017	吉视转债	5,978,402.10	0.30
4	110042	航电转债	5,485,642.00	0.27
5	127007	湖广转债	892,482.91	0.04
6	110049	海尔转债	519,782.40	0.03

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603707	健友股份	27,288,000.00	1.36	大宗流通受限
2	300271	华宇软件	14,568,000.00	0.73	大宗流通受限

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	883,306,323.94
报告期期间基金总申购份额	409,488,300.59
减：报告期期间基金总赎回份额	197,929,868.27
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期末基金份额总额	1,094,864,756.26

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金对本基金进行交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）募集的文件

2、关于申请募集兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）之法律意见书

3、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

4、基金托管人业务资格批件和营业执照

5、《兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金合同》

6、《兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

7、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 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。

兴全基金管理有限公司
2019年7月19日

兴全天添益货币市场基金

2019年第二季度报告

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
报告送出日期：2019年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2019年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全天添益货币
场内简称	-
基金主代码	001820
交易代码	001820
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
报告期末基金份额总额	23,337,421,363.86份
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。
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
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	18,377,867.66份	23,319,043,496.20份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年4月1日 - 2019年6月30日）	
	兴全天添益货币A	兴全天添益货币B
1. 本期已实现收益	103,577.81	160,134,409.42
2.本期利润	103,577.81	160,134,409.42
3.期末基金资产净值	18,377,867.66	23,319,043,496.20

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

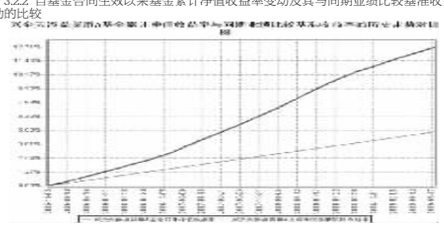
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6546%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3180%	0.0008%

兴全天添益货币B

阶段	净值收益率①	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	0.7148%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3782%	0.0008%

注：本基金收益分配按日结转份额。

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2019年6月30日。

2、按照《兴全天添益货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为自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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟秀华	本基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全稳益债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、兴全恒瑞三个月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	-	9年	医学硕士，历任华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、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全货币市场基金基金经理、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、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理。
王健	本基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券发起式证券投资基金基金经理	2018年8月10日	-	5年	经济学硕士，历任兴全基金管理有限公司固定收益部研究员、兴全添利宝货币市场基金基金经理助理、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。

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、《兴全天添益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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度，受到银行被托管事件的影响，低评级或有眼疾的银行主体同业存单发行难度上升；同业机构的风险偏好下降，回购市场出现明显的流动性分层。与此同时，监管机构对市场进行了有效干预，推出相关配套制度，市场担忧情绪较快平复，但预计其深远影响将长期存在。运作期内，本组合继续保持高流动性和安全性，积极调整资产配置结构，抓取确定性的交易机会，为持有人创造了超越基准的投资收益。

4.5 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0.6546%，本报告期兴全天添益货币B的基金份额净值收益率为0.7148%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	14,396,184,001.62	52.61
	其中：债券	14,396,184,001.62	52.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,973,668,600.50	29.14
	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	4,911,564,969.94	17.95
4	其他资产	82,472,248.99	0.30
5	合计	27,363,889,821.05	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	12.59	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,021,052,646.84	17.23
	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日融资余额占资产净值比例的简单平均值，故金额处不予填列。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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期限超过120天的情况。

5.3.2 报告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	43.43	17.23
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	17.90	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	15.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.26	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天（含）	36.62	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.90	17.23

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,780,978.51	0.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,513,504,403.09	6.49
	其中：政策性金融债	1,362,723,941.89	5.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,561,065,180.27	6.69
6	中期票据	50,216,027.46	0.22
7	同业存单	11,211,617,412.29	48.04
8	其他	-	-
9	合计	14,396,184,001.62	61.69
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160215	16国开15	4,100,000	410,048,239.39	1.76
2	111918188	19华夏银行CD188	3,000,000	298,216,863.28	1.28
3	111812207	18北京银行CD207	3,000,000	296,524,131.81	1.27
4	111980096	19重庆农村商行CD137	3,000,000	292,522,310.17	1.25
5	111808296	18中信银行CD296	2,600,000	257,278,612.90	1.10
6	111808198	18中信银行CD198	2,500,000	248,799,305.64	1.07
7	180312	18进出12	2,000,000	200,222,091.76	0.86
8	111882130	18广州银行CD058	2,000,000	199,365,326.39	0.85
9	111815579	18民生银行CD579	2,000,000	199,359,557.45	0.85
10	111908077	19中信银行CD077	2,000,000	199,293,779.71	0.85

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1242%
报告期内偏离度的最低值	0.0363%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0698%

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。

5.8 报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，华夏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	82,455,248.99
4	应收申购款	17,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	82,472,248.99

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全天添益货币A	兴全天添益货币B
报告期期初基金份额总额	17,562,448.97	21,203,596,656.56
报告期期间基金总申购份额	894,628,967.40	13,019,405,611.77
报告期期间基金总赎回份额	893,813,548.71	10,903,958,772.13
报告期期末基金份额总额	18,377,867.66	23,319,043,496.20

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2019年4月9日	90,000,000.00	90,000,000.00	0.00%
2	申购	2019年4月10日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
3	赎回	2019年4月16日	-70,000,000.00	-70,000,000.00	0.00%
4	红利再投资	2019年4月30日	917,627.16	917,627.16	0.00%
5	申购	2019年5月8日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
6	赎回	2019年5月16日	-30,000,000.00	-30,000,000.00	0.00%
7	赎回	2019年5月30日	-31,000,000.00	-31,000,000.00	0.00%
8	红利再投资	2019年5月28日	861,084.32	861,084.32	0.00%
9	红利再投资	2019年5月31日	83,707.47	83,707.47	0.00%
10	申购	2019年6月5日	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
11	红利再投资	2019年6月28日	874,171.97	874,171.97	0.00%
合计			61,736,590.92	61,736,590.92	

注：1、"交易日期"为交易确认日或分红权益登记日。

2、因本基金收益分配按日结转份额，上表中"红利再投资"数据为当月汇总数据。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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"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、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件

2、《兴全天添益货币市场基金基金合同》