兴全天添益货币市场基金 2019年半年度报告摘要

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:2019年8月24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2019年8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。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019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	兴全天添益货币	
场内简称	-	
基金主代码	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	
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	23,337,421,363.86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

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。本基金综合运用奥威配置、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。	
下属分级基金的风险收益特征	兴全天添益货币A	兴全天添益货币B
	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	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

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

基金级别	兴全天添益货币A	兴全天添益货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	203,779.56	292,870,803.96
本期利润	203,779.56	292,870,803.96
本期净值收益率	1.3509%	1.4715%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末基金资产净值	18,377,867.66	23,319,043,496.20
期末基金份额净值	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

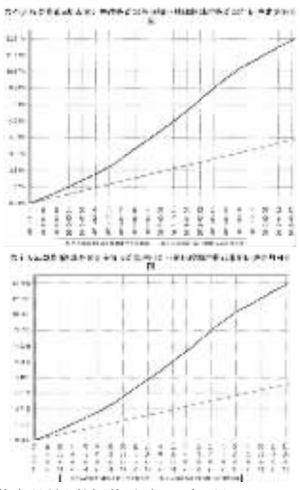
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2239%	0.0006%	0.1110%	0.0000%	0.1129%	0.0006%
过去三个月	0.6546%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3180%	0.0008%
过去六个月	1.3509%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	0.6814%	0.0011%
过去一年	3.0096%	0.0030%	1.3500%	0.0000%	1.6596%	0.0030%
过去三年	10.9449%	0.0030%	4.0500%	0.0000%	6.8949%	0.0030%
自成立以来	12.7106%	0.0029%	4.9340%	0.0000%	7.7766%	0.0029%

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
过去一个月	0.2436%	0.0005%	0.1110%	0.0000%	0.1326%	0.0005%
过去三个月	0.7148%	0.0008%	0.3366%	0.0000%	0.3782%	0.0008%
过去六个月	1.4715%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	0.8020%	0.0011%
过去一年	3.2569%	0.0030%	1.3500%	0.0000%	1.9069%	0.0030%
过去三年	11.7458%	0.0030%	4.0500%	0.0000%	7.6958%	0.0030%
自成立以来	13.7024%	0.0029%	4.9340%	0.0000%	8.7684%	0.0029%

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,本基金的建仓期为自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2019年6月30日,公司旗下管理着26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、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(LOF)、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。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟秀华	现任兴全基金固定收益部总监助理,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	2017年5月4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,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基金经理。
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型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。
邓娟	本基金,兴全添利宝货币市场基金和兴全鼎稳增利债券型证券投资基金基金经理助理。	2018年8月27日	2019年6月18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。

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 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

2019年上半年,国际贸易环境复杂多变,国内经济基本面承压;货币政策保持中性,合理充裕。短端资产收益率屡创新低,政策维稳力度较强,对冲市场的各种担忧情绪。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。

4.4.2 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1.3509%,本报告期兴全天添益货币B的基金份额净值收益率为1.4715%, 同期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

2019年下半年,国内经济基本面的压力仍在。金融供给侧改革下,中小商业银行被动收缩资产负债表, 预计信用风险事件仍会不断出现,政策仍会以维稳为主。短端资产收益率上下空间都较为有限。因此,后续会继续注重产品的流动性和安全性,同时兼顾投资收益。

4.6 管理人对报告期内本基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全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203,779.56元,向B类基金基金份额持有人分配利润292,870,803.96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:兴全天添益货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	4,911,564,969.94	4,179,154,602.57
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,396,184,001.62	5,526,923,293.12
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,396,184,001.62	5,526,923,293.12
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,973,668,600.50	4,528,732,353.11
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	82,455,248.99	72,973,782.35
应收股利		-	-
应收申购款		17,000.00	12,015,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		27,363,889,821.05	14,319,799,031.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,021,052,646.84	2,138,024,562.93
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,793,318.06	1,644,600.75
应付托管费		744,884.81	438,560.21
应付销售服务费		189,404.67	112,083.94
应付交易费用	6.4.7.7	523,583.17	432,593.79
应交税费		96,999.23	55,271.11
应付利息		976,291.11	1,487,867.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,329.30	154,000.00
负债合计		4,026,468,457.19	2,142,349,530.41
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	23,337,421,363.86	12,177,449,500.74
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		23,337,421,363.86	12,177,449,500.74
负债和所有者权益总计		27,363,889,821.05	14,319,799,031.15

注:报告截止日2019年6月30日,兴全天添益A基金份额净值1.0000元,基金份额总额18,377,867.66份;兴全天添益B基金份额净值1.0000元,基金份额总额23,319,043,496.20份。

6.2 利润表

会计主体:兴全天添益货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		341,125,623.83	160,182,049.22
1.利息收入		345,824,321.83	159,928,521.44
其中:存款利息收入	6.4.7.11	78,825,861.77	16,862,629.77
债券利息收入		168,754,514.97	103,179,808.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		98,243,945.09	39,886,083.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-4,698,698.00	162,827.02
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,698,698.00	162,827.02
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	90,700.76
减:二、费用		48,051,040.31	15,218,463.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,973,575.54	4,728,428.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,992,953.50	1,260,914.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,016,340.29	322,407.68
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		27,845,324.31	8,688,913.70
其中:卖出回购金融资产支出		27,845,324.31	8,688,913.70
6. 税金及附加		80,654.34	15,002.25
7. 其他费用	6.4.7.20	142,192.33	202,797.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		293,074,583.52	144,963,585.55
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		293,074,583.52	144,963,585.55

6.3 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:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	12,177,449,500.74	-	12,177,449,500.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	293,074,583.52	293,074,583.52
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)	11,159,971,863.12	-	11,159,971,863.12
其中:1.基金申购款	30,886,338,813.62	-	30,886,338,813.62
2.基金赎回款	-19,726,366,950.50	-	-19,726,366,950.50
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)	-	-293,074,583.52	-293,074,583.52
五、期末所有者权益(基金净值)	23,337,421,363.86	-	23,337,421,363.86
项目	上年度可比期间 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)	7,624,096,157.15	-	7,624,096,157.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	144,963,585.55	144,963,585.55
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)	-2,453,278,513.21	-	-2,453,278,513.21
其中:1.基金申购款	152,697,983.22	-	152,697,983.22
2.基金赎回款	-2,605,976,496.43	-	-2,605,976,496.43
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)	-	-144,963,585.55	-144,963,585.55
五、期末所有者权益(基金净值)	5,170,817,643.94	-	5,170,817,643.94

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

兴全天添益货币市场基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可证监许可【2015】1872号文《关于核准兴全天添益货币市场基金募集的批复》予以募集注册,由兴全基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2015年11月5日正式生效,首次设立募集规模为200,613,630.81份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴全基金管理有限公司,基金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、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、非金融企业债务融资工具、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2019年6月30日的财务状况以及2019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[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;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

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

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。

6.4.8.1.3 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。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,973,575.54	4,728,428.22
其中:支付销售机构的客户维护费	142,216.71	-

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,992,953.50	1,260,914.16

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。

6.4.8.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30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	18,773.49	976,482.00	995,255.49
合计	18,773.49	976,482.00	995,255.49
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6月30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	7,478.35	314,929.33	322,407.68
合计	7,478.35	314,929.33	322,407.68

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。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

本期 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	1,108,760,000.00	268,712.35
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	-	-	-	-	-

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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	兴全天添益货币A	兴全天添益货币B
期初持有的基金份额	-	300,428,387.68
期间申购/买入总份额	-	333,045,835.79
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	241,000,000.00
期末持有的基金份额	-	392,474,223.47
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.6817%
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	兴全天添益货币A	兴全天添益货币B
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

兴全天添益货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30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
基金托管人	6,927,239,095.79	29.6830%	3,744,589,085.99	30.7502%
兴业证券	752,621,315.17	3.2250%	305,291,825.72	2.5070%

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	11,564,969.94	174,491.07	14,230,536.21	192,639.07

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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430,000,000.00元,估值总额 425,808,285.86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(2019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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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4,021,052,646.84元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041800243	18电网CP001	2019年7月1日	100.37	1,120,000	112,417,962.15
111807156	18招商银行CD156	2019年7月1日	99.71	500,000	49,856,575.58
111808198	18中信银行CD198	2019年7月1日	99.52	450,000	44,783,875.02
111808296	18中信银行CD296	2019年7月1日	98.95	2,310,000	228,582,152.23
111808298	18中信银行CD298	2019年7月1日	99.53	1,000,000	99,528,524.17
111811313	18平安银行CD313	2019年7月1日	99.66	1,000,000	99,659,584.90
111814203	18江苏银行CD203	2019年7月1