兴业稳天盈货币市场基金

2021年第2季度报告

2021年06月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月19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2021年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业稳天盈货币	
基金主代码	002912	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年07月15日	
报告期末基金份额总额	28,124,419,444.28份	
投资目标	在保持基金资产的安全性和流动性的前提下，通过主动式管理，力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量方法，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定当期收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：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，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	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业稳天盈货币A	兴业稳天盈货币B

下属分级基金的交易代码	002912	005202
报告期末下属分级基金的份额总额	1,185,983,196.18份	26,938,436,248.10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(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	兴业稳天盈货币A	兴业稳天盈货币B
1.本期已实现收益	6,559,216.44	197,040,467.87
2.本期利润	6,559,216.44	197,040,467.87
3.期末基金资产净值	1,185,983,196.18	26,938,436,248.10

注：1、本基金收益分配按日结转份额。

2、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 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

兴业稳天盈货币A净值表现

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	0.5555%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2189%	0.0010%
过去六个月	1.1155%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	0.4460%	0.0011%
过去一年	2.2062%	0.0013%	1.3481%	0.0000%	0.8581%	0.0013%
过去三年	7.5994%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	3.5494%	0.0019%

自基金合同生效起至今	16.1399%	0.0028%	6.6965%	0.0000%	9.4434%	0.0028%

兴业稳天盈货币B净值表现

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	0.6157%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.2791%	0.0010%
过去六个月	1.2361%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	0.5666%	0.0011%
过去一年	2.4518%	0.0013%	1.3481%	0.0000%	1.1037%	0.0013%
过去三年	8.3781%	0.0019%	4.0500%	0.0000%	4.3281%	0.0019%
自基金合同生效起至今	12.2845%	0.0026%	5.1300%	0.0000%	7.1545%	0.0026%

注：1、本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。

2、本基金收益分配为按日结转份额。

3、自 2017 年 9 月 12 日起，本基金分设两类基金份额： A 类基金份额和 B 类基金份额。上述业绩表现按实际存续期计算。详情参阅相关公告。

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

§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	说明

		任职日期	离任日期	从业年限	
刘禹含	基金经理	2017-03-31	-	7年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2013年7月至2015年10月在万家基金管理有限公司担任债券交易员，主要从事债券交易工作。2015年11月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度国内总需求呈现"内需偏弱，外需偏强"的特征，结构性通胀持续演绎，上游大宗上涨带动PPI持续攀升，而下游需求偏弱，大宗上涨对中下游盈利挤压的不利效应逐步显现。外围发达经济体总体处于疫情后恢复阶段，阶段性通胀压力并未改变货币政策态度。国内货币政策保持稳健中性，流动性合理充裕，维持"稳货币+紧信用"的组合，

叠加财政后置，资金面持续超预期宽松，中短端债券收益下行相对明显，债市迎来了一波"牛陡"行情，短端资金利率和一年国股存单以在政策利率以下运行为主，信用利差收窄至历史低位。

报告期内，组合保持偏积极的久期水平，根据市场情况综合比较各类资产的性价比，灵活调整各类资产的配置比例和期限分布，保持组合的流动性。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业稳天盈货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5555%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%；截至报告期末兴业稳天盈货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6157%，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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§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	20,017,140,025.31	64.74
	其中：债券	19,407,729,539.77	62.77
	资产支持证券	609,410,485.54	1.97
2	买入返售金融资产	6,546,375,661.07	21.17
	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	3,564,554,730.29	11.53
4	其他资产	791,402,505.85	2.56
5	合计	30,919,472,922.52	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	4.64
	其中：买断式回购融资	-	-

2	报告期末债券回购融资余额	2,782,775,888.60	9.89
	其中：买断式回购融资	-	-

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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

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	44.66	9.89
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.60	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	8.79	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	29.51	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
合计		109.43	9.89

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

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	239,972,034.12	0.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,103,362,354.48	7.48
	其中：政策性金融债	1,300,296,377.75	4.62
4	企业债券	223,045,035.91	0.79
5	企业短期融资券	4,932,083,596.38	17.54
6	中期票据	251,337,768.17	0.89
7	同业存单	11,657,928,750.71	41.45
8	其他	-	-
9	合计	19,407,729,539.77	69.01
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名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	112199039	21重庆农村商行CD097	10,000,000	998,021,445.74	3.55
2	210201	21国开01	6,500,000	649,257,036.44	2.31
3	112120073	21广发银行CD073	6,500,000	641,835,947.91	2.28
4	112109020	21浦发银行CD020	6,000,000	590,304,523.96	2.10
5	112116009	21上海银行CD009	5,000,000	499,524,346.90	1.78
6	112108042	21中信银行CD	5,000,000	493,825,234.74	1.76

		042			
7	190202	19国开02	4,400,000	441,150,219.50	1.57
8	112198946	21湖北银行CD014	4,000,000	399,190,280.62	1.42
9	112193653	21成都银行CD031	4,000,000	398,015,357.73	1.42
10	112198300	21徽商银行CD029	4,000,000	396,626,667.15	1.41

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	0.0762%
报告期内偏离度的最低值	0.0497%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0662%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无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

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

5.8 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	179534	致远03A2	1,000,000	100,000,000.00	0.36
2	136006	永熙优36	560,000	56,000,000.00	0.20
3	179211	20信易5A	500,000	50,351,243.78	0.18
4	138984	20合信02	400,000	40,011,881.02	0.14
5	137586	永熙优34	400,000	40,000,000.00	0.14
6	137507	20睿成04	350,000	35,000,000.00	0.12
7	137492	诚意4A1	310,000	31,000,000.00	0.11
8	179987	致远07A1	300,000	30,000,000.00	0.11
9	179555	21绿城A1	290,000	29,000,000.00	0.10

10	179447	链科12优	290,000	29,000,000.00	0.10

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

5.9.2 报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体中：（1）中信银行：2021年3月4日，山西银保监局对中信银行太原分行责令改正，罚款600万元，违规事由包括违规提供兜底承诺；2021年2月20日，山东银保监局对中信银行济南分行罚款225万元，违规事由包括商业承兑汇票贸易背景审查不严，二手房按揭贷款审查不到位等。（2）浦发银行：2021年4月14日，中国银保监会舟山监管分局对交通银行舟山分行罚款人民币55万元，违规事由包括，违规向关系人发放信用贷款；2021年4月16日，河南银保监局对交通银行河南省分行罚款50万元，违规事由包括个人线上贷款管控不到位，导致信贷资金违规流入限制性领域。（3）广发银行：广发银行于2020年7月7日收到广东银保监局行政处罚决定书（粤银保监罚决字[2020]27号），对违反审慎经营规则进行处罚220万元。2020年7月11日，广东证监局对广发证券采取责令改正、暂停保荐机构资格6个月、暂不受理债券承销业务有关文件12个月、责令限制高级管理人员权利的监管措施。违法事实包括：在康美药业股份有限公司2014年非公开发行优先股项目、2015年公司债券项目、2016年非公开发行股票项目、2018年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司2017年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部质量控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务。

该证券经信用研究员出具相关意见，并进行债券入库审批流程，基金管理人经过研究判断，按照相关投资决策流程投资了该债券。除此以外，本基金投资决策程序均符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期出现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、处罚以致于影响投资决策流程的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	95,731.52
2	应收证券清算款	649,437,937.95
3	应收利息	133,034,907.52
4	应收申购款	8,833,928.86
5	其他应收款	-

6	其他	-
7	合计	791,402,505.85

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业稳天盈货币A	兴业稳天盈货币B
报告期期初基金份额总额	1,221,116,872.09	30,580,863,006.72
报告期期间基金总申购份额	653,272,382.13	11,054,133,498.38
报告期期间基金总赎回份额	688,406,058.04	14,696,560,257.00
报告期期末基金份额总额	1,185,983,196.18	26,938,436,248.10

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§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	赎回	2021-04-12	33,000,000.00	33,000,000.00	0.00
2	赎回	2021-04-28	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00
合计			63,000,000.00	63,000,000.00	

本基金收益分配为按日结转份额，本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,638,605.16份，金额为1,638,605.16元，适用费率为0。

§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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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

（一）中国证监会准予兴业稳天盈货币市场基金募集注册的文件

（二）《兴业稳天盈货币市场基金基金合同》

（三）《兴业稳天盈货币市场基金托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站：http：//www.cib-fund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司

2021年07月21日