兴业添天盈货币市场基金

2022 年中期报告

2022 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 31 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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年8月26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2022年1月1日起至2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 41
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 债券回购融资情况 42
7.3 基金投资组合平均剩余期限 42
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 43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 44
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 45
7.8 期末按公允价值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 45
7.9 投资组合报告附注 46
§8 基金份额持有人信息 47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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情况 48
§9 开放式基金份额变动 48

§10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
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 49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 49
10.8 偏离度绝对值超过 **0.5%**的情况 51
10.9 其他重大事件 51
§11 影响投资者决策的其他重要信息 52
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 52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 52
§12 备查文件目录 52
12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 53
12.3 查阅方式 53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业添天盈货币市场基金	
基金简称	兴业添天盈货币	
基金主代码	001624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月23日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,650,449,723.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
下属分级基金的交易代码	001624	001625
报告期末下属分级基金的份额总额	6,131,084,040.97份	519,365,682.14份

2.2 基金产品说明

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。

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		兴业基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披	姓名	张玲菡	陆志俊

露负责人	联系电话	021-22211888	95559
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40000-95561	95559
传真		021-22211997	021-62701216
注册地址		福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区银城路167号13、14层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		官恒秋	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城路167号13、14层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区银城路167号13、14层

§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（2022年01月01日-2022年06月30日）	
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
本期已实现收益	55,392,790.93	4,694,160.40

本期利润	55,392,790.93	4,694,160.40
本期净值收益率	1.0262%	1.1463%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末基金资产净值	6,131,084,040.97	519,365,682.14
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
累计净值收益率	20.1992%	22.2173%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

兴业添天盈货币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	0.1502%	0.0014%	0.1110%	0.0000%	0.0392%	0.0014%
过去三个月	0.4838%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.1472%	0.0015%
过去六个月	1.0262%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	0.3567%	0.0014%
过去一年	2.1603%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	0.8103%	0.0015%
过去三年	6.9377%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	2.8877%	0.0027%
自基金合同生效起至今	20.1992%	0.0034%	9.3686%	0.0000%	10.8306%	0.0034%

注：本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。本基金收益分配为按日结转份额。

兴业添天盈货币B

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.1699%	0.0014%	0.1110%	0.0000%	0.0589%	0.0014%
过去三个月	0.5439%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.2073%	0.0015%
过去六个月	1.1463%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	0.4768%	0.0014%
过去一年	2.4054%	0.0015%	1.3500%	0.0000%	1.0554%	0.0015%
过去三年	7.7081%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	3.6581%	0.0027%
自基金合同生效起至今	22.2173%	0.0034%	9.3686%	0.0000%	12.8487%	0.0034%

注：本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

兴业基金管理有限公司（以下简称"兴业基金"或"公司"）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股的全国性基金管理公司。公司注册资本12亿元人民币，其中，兴业银行出资10.8亿元，持股比例90%，中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前，兴业基金已在北京、上海、深圳、福州等地设立分公司，并全资拥有基金子公司--兴业财富资产管理有限公司。

站在新时代的潮头浪尖，兴业基金不忘"受人之托、代客理财"的初心本源，牢记"打造一家市场化程度高、专业性强、特色鲜明的优秀基金公司"的责任使命，坚守"合规、诚信、专业、稳健"的行业文化，不断提升主动管理能力，打磨产品线，强化核心竞争力，提升权益投资能力，巩固扩大固收优势并增强特色业务，致力于为广大投资者创造长期良好收益，为中国实体经济健康发展贡献自身应有力量。截至2022年06月30日，兴业基金共管理79只公募基金。

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		
王卓然	基金经理	2020-01-21	-	7年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2015年6月至2017年4月在成都农村商业银行金融市场事业部担任债券交易员、投资顾问；2017年5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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

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 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

回顾上半年，市场焦点主要聚集在疫情演变对经济增长造成的冲击以及经济修复的斜率。货币政策维持宽松基调，实体经济融资需求疲软，地产行业处于下行周期叠加融资环境恶化，“宽信用”缺乏落实的载体。二季度资产荒行情再现，信用品质表现优于利率品种。利率债总体呈现区间震荡走势，总体围绕着资金面宽松的现实与“宽信用”预期的博弈，信用债则资产荒行情再现，出现一波牛市，信用利差进一步压缩至历史相对低位。

报告期内，组合充分利用久期策略、杠杆策略，结合负债特点合理布局资产到期时点，把握流动性边际变化带来资产价格走高的时点投放资产，为持有人提供流动性和收益型兼顾的流动性管理工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业添天盈货币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1.0262%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末兴业添天盈货币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1.1463%，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

展望未来，外围发达经济体衰退将由预期进入到现实的可能性在提升，一旦美国通胀见顶，市场对收缩预期充分定价，美债收益率和美元指数见顶回落，对国内货币政策的制约将减轻。国内方面，尽管在疫情形势好转下经济继续延续复苏的态势，但居民缩表的现象依然存在、制造业盈利周期下行、地产领域流动性压力依然在蔓延以及出口下行等因素，实体经济融资需求难以显著改善，经济反弹的力度相对有限。货币政策将继续维持相对宽松状态，国内方面总需求依然维持偏弱状态，而温和回升的通胀尚难以形成央行货币政策的掣肘。预计后市利率债总体保持震荡走势，陡峭化的收益率曲线有望走平；信用债方面，在债市总体震荡的预判下，信用债具有票息策略相对占优。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，按日进行支付。报告期内本基金向A级份额持有人分配利润55,392,790.93元，向B级份额持有人分配利润4,694,160.40元。

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

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 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

2022上半年度，托管人在兴业添天盈货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2022上半年度，兴业基金管理有限公司在兴业添天盈货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A级份额持有人分配利润：55,392,790.93元，向B级份额持有人分配利润：4,694,160.40元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2022上半年度，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有兴业添天盈货币市场基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：兴业添天盈货币市场基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	707,362,337.81	1,073,509,291.36
结算备付金		27,500,178.10	427,272.73
存出保证金		9,007.89	1,198.40
交易性金融资产	6.4.7.2	4,707,679,561.79	3,216,553,491.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,547,092,346.79	3,073,062,717.36
资产支持证券投资		160,587,215.00	143,490,774.34
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,739,494,033.81	586,045,039.08
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-

其他权益工具投资		-	-
应收清算款		7,465.76	-
应收股利		-	-
应收申购款		365,687.57	141,218.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	25,444,166.22
资产总计		7,182,418,272.73	4,902,121,677.49
负债和净资产	**附注号**	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021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		528,237,231.78	338,499,630.75
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,577,876.01	999,040.48
应付托管费		292,199.25	185,007.50
应付销售服务费		1,306,145.38	867,391.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		57,152.09	76,298.17
应付利润		321,204.69	326,709.35
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	176,740.42	252,372.54
负债合计		531,968,549.62	341,206,450.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,650,449,723.11	4,560,915,227.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		6,650,449,723.11	4,560,915,227.43
负债和净资产总计		7,182,418,272.73	4,902,121,677.49

注：1、报告截止日2022年06月30日，基金份额净值1.00元，基金份额总额6,650,449,723.11份，其中下属A类基金份额6,131,084,040.97份，B类基金份额519,365,682.14份。

2、上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：兴业添天盈货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
一、营业总收入		78,145,716.18	33,995,304.78
1.利息收入		23,209,483.65	32,697,073.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,479,358.23	5,464,140.71
债券利息收入		-	20,484,012.24
资产支持证券利息收入		-	1,506,906.96
买入返售金融资产收入		11,730,125.42	5,242,013.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		54,936,135.31	1,297,588.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	52,649,980.81	1,237,321.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	2,286,154.50	60,267.75
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	97.22	642.43
减：二、营业总支出		18,058,764.85	7,485,893.05
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	7,882,892.26	3,014,927.91
2．托管费	6.4.10.2.2	1,459,794.84	558,320.04
3．销售服务费	6.4.10.2.3	6,796,124.84	2,658,092.03
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		1,750,221.05	1,107,105.17
其中：卖出回购金融资产支出		1,750,221.05	1,107,105.17
6．信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		33,717.92	12,711.83
8．其他费用	6.4.7.18	136,013.94	134,736.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,086,951.33	26,509,411.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,086,951.33	26,509,411.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		60,086,951.33	26,509,411.73

注：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业添天盈货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,560,915,227.43	-	-	4,560,915,227.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,560,915,227.43	-	-	4,560,915,227.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,089,534,495.68	-	-	2,089,534,495.68
（一）、综合收益总额	-	-	60,086,951.33	60,086,951.33
（二）、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）	2,089,534,495.68	-	-	2,089,534,495.68
其中：1.基金申购款	21,412,164,182.05	-	-	21,412,164,182.05
2.基金赎回款	-19,322,629,686.37	-	-	-19,322,629,686.37

（三）、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）	-	-	-60,086,951.33	-60,086,951.33
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	6,650,449,723.11	-	-	6,650,449,723.11
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,829,021,568.08	-	-	1,829,021,568.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,829,021,568.08	-	-	1,829,021,568.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,221,681,920.09	-	-	1,221,681,920.09
（一）、综合收益总额	-	-	26,509,411.73	26,509,411.73
（二）、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）	1,221,681,920.09	-	-	1,221,681,920.09
其中：1.基金申购款	13,402,972,551.37	-	-	13,402,972,551.37
2.基金赎回	-12,181,290,	-	-	-12,181,290,

款	631.28			631.28
（三）、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）	-	-	-26,509,411.73	-26,509,411.73
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	3,050,703,488.17	-	-	3,050,703,488.17

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:

官恒秋	张顺国	夏鹏
————————	————————	————————
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

兴业添天盈货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业添天盈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]1289号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为200,021,402.26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(15)第1227号的验资报告。基金合同于2015年7月23日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额(以下简称"兴业添天盈货币A")和B类基金份额(以下简称"兴业添天盈货币B")两类份额。其中，兴业添天盈货币A是指按照0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别；兴业添天盈货币B是指按照0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，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，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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

根据《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自2022年1月1日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币0.00元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款、应付利息，金额分别为人民币1,073,509,291.36元、人民币427,272.73元、人民币1,198.40元、人民币586,045,039.08元、人民币25,444,166.22元、人民币338,499,630.75元、人民币23,277.25元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款、其他负债-应付利息，金额分别为人民币1,080,625,632.36元、人民币427,484.26元、人民币1,198.95元、人民币586,735,664.53元、人民币0.00元、人民币338,522,908.00元、人民币0.00元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币3,216,553,491.70元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币17,636,987.69元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币3,234,190,479.39元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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，暂不计缴企业所得税。

3）基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	2,754,670.60
等于：本金	2,750,645.98
加：应计利息	4,024.62
减：坏账准备	-
定期存款	704,607,667.21
等于：本金	700,000,000.00
加：应计利息	4,607,667.21
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	704,607,667.21
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

合计	707,362,337.81

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	234,206,004.41	234,699,248.17	493,243.76	0.0074
	银行间市场	4,312,886,342.38	4,318,604,382.44	5,718,040.06	0.0860
	合计	4,547,092,346.79	4,553,303,630.61	6,211,283.82	0.0934
资产支持证券		160,587,215.00	160,687,623.57	100,408.57	0.0015
合计		4,707,679,561.79	4,713,991,254.18	6,311,692.39	0.0949

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	158,968,948.00	-
银行间市场	1,580,525,085.81	-

合计	1,739,494,033.81	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	83,437.86
其中：交易所市场	-
银行间市场	83,437.86
应付利息	-
预提费用	93,302.56
合计	176,740.42

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 兴业添天盈货币A

金额单位：人民币元

项目 (兴业添天盈货币A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,411,029,251.35	4,411,029,251.35
本期申购	19,863,002,251.72	19,863,002,251.72
本期赎回（以“-”号填列）	-18,142,947,462.10	-18,142,947,462.10
本期末	6,131,084,040.97	6,131,084,040.97

6.4.7.7.2 兴业添天盈货币B

金额单位：人民币元

项目 (兴业添天盈货币B)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,885,976.08	149,885,976.08
本期申购	1,549,161,930.33	1,549,161,930.33
本期赎回（以“-”号填列）	-1,179,682,224.27	-1,179,682,224.27
本期末	519,365,682.14	519,365,682.14

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。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 兴业添天盈货币A

单位：人民币元

项目 (兴业添天盈货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	55,392,790.93	-	55,392,790.93
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	-55,392,790.93	-	-55,392,790.93
本期末	-	-	-

6.4.7.8.2 兴业添天盈货币B

单位：人民币元

项目 (兴业添天盈货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	4,694,160.40	-	4,694,160.40
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	-4,694,160.40	-	-4,694,160.40
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	67,295.80
定期存款利息收入	11,360,714.58
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	51,294.59
其他	53.26
合计	11,479,358.23

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期间无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	52,212,849.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	437,131.49
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	52,649,980.81

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,890,801,173.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,862,922,451.07
减：应计利息总额	27,441,416.54
减：交易费用	174.00
买卖债券差价收入	437,131.49

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	2,286,154.50
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,286,154.50

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日

卖出资产支持证券成交总额	114,838,199.64
减：卖出资产支持证券成本总额	112,937,500.00
减：应计利息总额	1,900,699.64
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期间无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期间无公允价值变动收益。

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	97.22
合计	97.22

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37

汇划手续费	34,691.38
帐户维护费	17,020.00
合计	136,013.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	基金托管人
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司

注：本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,882,892.26	3,014,927.91
其中：支付销售机构的客户维护费	3,784,406.82	1,466,113.20

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.27%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,459,794.84	558,320.04

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

名称	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B	合计
兴业基金	13,039.92	8,597.98	21,637.90
兴业银行	10,269.76	73.98	10,343.74
合计	23,309.68	8,671.96	31,981.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B	合计
兴业基金	19,436.88	3,062.52	22,499.40
兴业银行	7,247.54	65.76	7,313.30
合计	26,684.42	3,128.28	29,812.70

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、B两类基金份额：A类基金按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，B类基金按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给兴业基金，再交由兴业基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A类基金日销售服务费=前一日A类基金份额对应的资产净值×0.25%÷当年天数；

B类基金日销售服务费=前一日B类基金份额对应的资产净值×0.01%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易的情况。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

兴业添天盈货币A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00

减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

兴业添天盈货币B

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,187,195.55	9,932,208.27
报告期间申购/买入总份额	117,022.36	129,956.36
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,304,217.91	10,062,164.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.98%	8.10%

注：1、关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

2、申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

3、本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资兴业添天盈A的情况。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

兴业添天盈货币B

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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
兴业财富	15,995,333.82	3.0798%	15,813,678.99	10.5505%

注：1、关联方投资本基金采用公允费率，即按照基金法律文件条款执行。

2、本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资兴业添天盈A的情况。

6.4.10.5 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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,754,670.60	67,295.80	938,603.78	34,684.50

注：本基金的活期银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业或协议利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间及上年度可比期间无须说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

兴业添天盈货币A

单位：人民币元

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
55,414,837.98	-	-22,047.05	55,392,790.93	-

兴业添天盈货币B

单位：人民币元

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
4,677,618.01	-	16,542.39	4,694,160.40	-

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30日，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528,237,231.78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
112221056	22渤海银行CD056	2022-07-01	99.64	1,000,000	99,642,259.93
112221094	22渤海银行CD094	2022-07-01	99.43	275,000	27,342,088.78
112295453	22徽商银行CD022	2022-07-01	99.44	1,000,000	99,437,018.33
120232	12国开32	2022-07-01	104.01	1,500,000	156,015,457.68
150221	15国开21	2022-07-01	103.02	500,000	51,508,691.83
190214	19国开14	2022-07-01	102.24	50,000	5,112,201.96
190308	19进出08	2022-07-01	102.43	300,000	30,728,565.49
210216	21国开16	2022-07-01	101.48	610,000	61,900,219.78
220401	22农发01	2022-07-01	100.46	500,000	50,231,282.63
合计				5,735,000	581,917,786.41

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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基金管理人旗下其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并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。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	40,397,808.22	80,001,581.92

A-1以下	0.00	0.00
未评级	417,476,146.11	509,949,201.78
合计	457,873,954.33	589,950,783.70

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1以下	0.00	0.00
未评级	3,309,368,279.83	1,851,896,942.85
合计	3,309,368,279.83	1,851,896,942.85

6.4.13.2.4 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	369,362,781.63	281,390,159.78
AAA以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	369,362,781.63	281,390,159.78

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	160,587,215.00	143,490,774.34
AAA以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	160,587,215.00	143,490,774.34

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人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。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过"影子定价"机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值， 因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金基金管理人主要通过对利率敏感度缺口定期监控等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	707,362,337.81	-	-	-	707,362,337.81
结算备付金	27,500,178.10	-	-	-	27,500,178.10
存出保证金	9,007.89	-	-	-	9,007.89
交易性金融资产	4,707,679,561.79	-	-	-	4,707,679,561.79
买入返售金融资产	1,739,494,033.81	-	-	-	1,739,494,033.81
应收清算款	-	-	-	7,465.76	7,465.76
应收申购款	-	-	-	365,687.57	365,687.57
资产总计	7,182,045,119.40	-	-	373,153.33	7,182,418,272.73
负债					
卖出回购金融资产款	528,237,231.78	-	-	-	528,237,231.78
应付管理人报酬	-	-	-	1,577,876.01	1,577,876.01
应付托管费	-	-	-	292,199.25	292,199.25
应付销售服务费	-	-	-	1,306,145.38	1,306,145.38

应交税费	-	-	-	57,152.09	57,152.09
应付利润	-	-	-	321,204.69	321,204.69
其他负债	-	-	-	176,740.42	176,740.42
负债总计	528,237,231.78	-	-	3,731,317.84	531,968,549.62
利率敏感度缺口	6,653,807,887.62	-	-	-3,358,164.51	6,650,449,723.11
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,073,509,291.36	-	-	-	1,073,509,291.36
结算备付金	427,272.73	-	-	-	427,272.73
存出保证金	1,198.40	-	-	-	1,198.40
交易性金融资产	3,216,553,491.70	-	-	-	3,216,553,491.70
买入返售金融资产	586,045,039.08	-	-	-	586,045,039.08
应收利息	-	-	-	25,444,166.22	25,444,166.22
应收申购款	-	-	-	141,218.00	141,218.00
资产总计	4,876,536,293.27	-	-	25,585,384.22	4,902,121,677.49
负债					
卖出回购金融资产款	338,499,630.75	-	-	-	338,499,630.75
应付管理人报酬	-	-	-	999,040.48	999,040.48
应付托管费	-	-	-	185,007.50	185,007.50
应付销	-	-	-	867,391.27	867,391.27

售服务费					
应付交易费用	-	-	-	50,095.29	50,095.29
应交税费	-	-	-	76,298.17	76,298.17
应付利息	-	-	-	23,277.25	23,277.25
应付利润	-	-	-	326,709.35	326,709.35
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	338,499,630.75	-	-	2,706,819.31	341,206,450.06
利率敏感度缺口	4,538,036,662.52	-	-	22,878,564.91	4,560,915,227.43

注：上表按照合约规定的利率重定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	2、利率曲线平行移动		
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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升25个基点	-4,200,455.85	-2,663,737.91
	市场利率下降25个基点	4,203,165.42	2,673,145.70

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他重大价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	4,707,679,561.79	3,216,553,491.70
第三层次	-	-
合计	4,707,679,561.79	3,216,553,491.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	4,707,679,561.79	65.54
	其中：债券	4,547,092,346.79	63.31
	资产支持证券	160,587,215.00	2.24
2	买入返售金融资产	1,739,494,033.81	24.22
	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	734,862,515.91	10.23
4	其他各项资产	382,161.22	0.01
5	合计	7,182,418,272.73	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.40	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	528,237,231.78	7.94
	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%。

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	101
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

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。

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	36.60	7.94
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	12.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	14.26	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	36.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.58	7.94

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

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。

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	公允价值	占基金资产净值比例

			(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	695,747,326.70	10.46
	其中：政策性金融债	410,487,331.00	6.17
4	企业债券	234,206,004.41	3.52
5	企业短期融资券	235,826,907.82	3.55
6	中期票据	71,943,828.03	1.08
7	同业存单	3,309,368,279.83	49.76
8	其他	-	-
9	合计	4,547,092,346.79	68.37
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112281502	22台州银行CD017	2,000,000	199,116,482.47	2.99
2	112221094	22渤海银行CD094	2,000,000	198,851,554.75	2.99
3	112214084	22江苏银行CD084	2,000,000	195,504,803.98	2.94
4	112175207	21成都农商银行CD256	1,600,000	159,330,580.54	2.40
5	112295113	22华融湘江银行CD053	1,600,000	158,033,940.99	2.38
6	120232	12国开32	1,500,000	156,015,457.68	2.35
7	112280129	22华侨永亨中	1,000,000	99,675,850.1	1.50

		国CD008		0	
8	112221056	22渤海银行CD056	1,000,000	99,642,259.93	1.50
9	112295453	22徽商银行CD022	1,000,000	99,437,018.33	1.50
10	112219103	22恒丰银行CD103	1,000,000	99,386,868.50	1.49

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.1229%
报告期内偏离度的最低值	0.0256%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0796%

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。

7.8 期末按公允价值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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180025	天行02优	320,000	32,073,152.88	0.48
2	189763	21天圆02	200,000	20,508,264.13	0.31
3	183574	天行01优	200,000	20,170,958.90	0.30
4	189773	2天智02A	150,000	15,384,903.31	0.23

5	193120	2天智03A	120,000	12,256,320.27	0.18
6	136784	徐矿27A	100,000	10,147,441.10	0.15
7	183052	逸信01优	100,000	10,145,315.07	0.15
8	183402	链科41优	100,000	10,135,057.53	0.15
9	183488	金诚10A	100,000	10,104,263.01	0.15
10	193997	31租赁2A	250,000	9,465,890.07	0.14

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的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	9,007.89
2	应收清算款	7,465.76
3	应收利息	-
4	应收申购款	365,687.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	382,161.22

§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

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
兴业添天盈货币A	1,294,713	4,735.48	20,470,856.58	0.3339%	6,110,613,184.39	99.6661%
兴业添天盈货币B	50	10,387,313.64	477,023,394.57	91.8473%	42,342,287.57	8.1527%
合计	1,294,763	5,136.42	497,494,251.15	7.4806%	6,152,955,471.96	92.5194%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，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两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	100,597,466.93	1.6408%
2	券商类机构	40,114,190.30	0.6543%
3	个人	36,988,315.15	0.6033%
4	个人	30,993,926.63	0.5055%
5	其他机构	30,001,700.56	0.4893%
6	其他机构	25,065,469.40	0.4088%

7	其他机构	20,132,953.14	0.3284%
8	其他机构	20,012,743.45	0.3264%
9	基金类机构	15,995,333.82	0.2609%
10	信托类机构	15,054,142.62	0.2455%

8.3 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	兴业添天盈货币A	16,662.32	0.0003%
	兴业添天盈货币B	0.00	0.0000%
	合计	16,662.32	0.0003%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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（即期末基金份额总额）。

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	兴业添天盈货币A	0~10
	兴业添天盈货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴业添天盈货币A	0
	兴业添天盈货币B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
基金合同生效日(2015年07月23日)基金份额总额	21,402.26	200,000,000.00

本报告期期初基金份额总额	4,411,029,251.35	149,885,976.08
本报告期基金总申购份额	19,863,002,251.72	1,549,161,930.33
减：本报告期基金总赎回份额	18,142,947,462.10	1,179,682,224.27
本报告期期末基金份额总额	6,131,084,040.97	519,365,682.14

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未产生基金份额持有人大会决议。

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、2022年1月13日，云凤生先生担任兴业基金管理有限公司首席信息官，详见本公司于2022年1月14日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、2022年8月8日，张玲菡女士离任兴业基金管理有限公司副总经理，担任兴业基金管理有限公司督察长，总经理胡斌先生不再代行督察长职务。详见本公司于2022年8月9日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、本报告期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

本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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内基金管理人和基金托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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		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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即 ：

ⅰ资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。

ⅱ财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。

ⅲ内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

ⅳ投研交综合实力较强。

ⅴ其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③在上述租用的券商交易单元中，本期未新增、剔除券商交易单元。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	173,938,389.50	100.00%	12,086,801,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 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	兴业基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关准则的公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-01
2	兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022-01-14
3	兴业基金管理有限公司旗下基金2021年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-01-22

4	兴业基金管理有限公司旗下公募基金招募说明书（更新）(2022年第1号)	中国证监会规定的媒介	2022-03-06
5	兴业基金管理有限公司旗下公募基金2021年年度报告	中国证监会规定的媒介	2022-03-31
6	兴业基金管理有限公司旗下基金2022年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2022-04-22
7	关于网络平台冒用“兴业基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会规定的媒介	2022-04-25
8	兴业基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28
9	兴业基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定的媒介	2022-05-28

§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

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者超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业添天盈货币市场基金募集注册的文件

（二）《兴业添天盈货币市场基金基金合同》

（三）《兴业添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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

12.3 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

二〇二二年八月三十一日