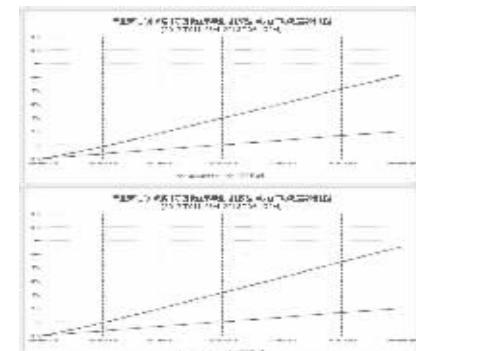


## 兴业安润货币市场基金

### 2018年第二季度报告



注 1. 本基金基金合同于 2017 年 1 月 6 日生效,截至报告期末本基金基金份额持有人共 10,000 人。  
2. 根据本基金基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

#### § 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	任职日期	离任日期
杜志强	基金经理	2017-01-06	2018-06-05
杜志强	基金经理	2018-06-05	-

1. 对基金的聘任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据基金合同规定解除聘任日期,除聘任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据基金合同规定确定的聘任日期和离聘日期。  
2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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础和投资组合。  
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  
报告期内,信用风险密集爆发的背景下,本基金严格控制信用风险,管理人通过紧密实地调研,系统排查 AAA 以下信用债的潜在信用风险,并持续关注其结构性调整,增加利率债和高等级利率债持仓,减少中低等级信用债持仓,同时,信用风

动性趋于宽松,在投资运作上,及时做好市场形势研判,做好货币市场季节性走势研究,把握政策变动布局前瞻性跨季跨季,平衡跨季度时点的再配置风险和流动性风险,适度自留杠杆,同时加强负债管理,确保合规运作。下一步管理人将继续加强宏观形势研判,严格做好组合负债管理,在保持组合流动性安全的前提下,合理配置资产到期时点及整体组合期限,力争在低资产波动性和安全性的前提下提高组合收益。

4.5 报告期内基金的投资表现  
本报告期内,A 类基金份额净值收益率为 1.0147%,同期业绩比较基准收益率为 0.3366%,B 类基金份额净值收益率为 1.075%,同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

本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一百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

4.6 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益类资产	19,967,036,764.42	38.41
2	权益类资产	19,776,976,541.90	38.04
3	其他资产	180,332,222.52	0.37
4	其他资产	4,828,216,823.33	9.29
5	合计	26,589,033,216.83	51.66
6	其他资产	334,250,392.38	0.64
7	合计	51,988,509,255.96	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

4.7 报告期内基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	报告期末债券回购融资余额	-	5.47
2	报告期末债券回购融资余额	5,408,185,717.45	11.62

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例  
本报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

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**

本基金投资范围不包括股指期货合约。