

兴业鑫天盈货币市场基金

2019年第一季度报告

走势研判,继续做好负债管理 and 流动性风险管理,重点监控各项指标,确保合规运作,在确保流动性的前提下,兼顾安全性和收益性。

4.5 报告期内基金的投资策略和运作分析
截至报告期末,兴业鑫天盈货币市场基金资产净值为1,000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.0111%,同期业绩比较基准收益率为0.0229%;截至报告期末,兴业鑫天盈货币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0.0330%,同期业绩比较基准收益率为0.0326%。

4.6 报告期内基金持有人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元的情形。

§ 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	2,311,617,844.62	40.06
	其中:债券	2,311,617,844.62	40.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,643,804,581.71	29.12
	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	1,630,044,576.99	28.88
4	其他资产	58,182,249.30	1.04
5	合计	5,644,319,256.62	100.00

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末国债债券投资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末央行票据投资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-
3	报告期末金融债券投资余额	239,965,440.02	4.44
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期末基金资产组合中,报告期末国债债券投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日国债债券投资余额占基金资产净值的比例。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期末股票投资余额	-	-
2	报告期末股票投资余额	-	-
3	报告期末股票投资余额	-	-
4	报告期末股票投资余额	-	-
5	报告期末股票投资余额	-	-
6	报告期末股票投资余额	-	-
7	报告期末股票投资余额	-	-
8	报告期末股票投资余额	-	-
9	报告期末股票投资余额	-	-
10	报告期末股票投资余额	-	-
11	报告期末股票投资余额	-	-
12	报告期末股票投资余额	-	-
13	报告期末股票投资余额	-	-
14	报告期末股票投资余额	-	-
15	报告期末股票投资余额	-	-
16	报告期末股票投资余额	-	-
17	报告期末股票投资余额	-	-
18	报告期末股票投资余额	-	-
19	报告期末股票投资余额	-	-
20	报告期末股票投资余额	-	-
21	报告期末股票投资余额	-	-
22	报告期末股票投资余额	-	-
23	报告期末股票投资余额	-	-
24	报告期末股票投资余额	-	-
25	报告期末股票投资余额	-	-
26	报告期末股票投资余额	-	-
27	报告期末股票投资余额	-	-
28	报告期末股票投资余额	-	-
29	报告期末股票投资余额	-	-
30	报告期末股票投资余额	-	-
31	报告期末股票投资余额	-	-
32	报告期末股票投资余额	-	-
33	报告期末股票投资余额	-	-
34	报告期末股票投资余额	-	-
35	报告期末股票投资余额	-	-
36	报告期末股票投资余额	-	-
37	报告期末股票投资余额	-	-
38	报告期末股票投资余额	-	-
39	报告期末股票投资余额	-	-
40	报告期末股票投资余额	-	-
41	报告期末股票投资余额	-	-
42	报告期末股票投资余额	-	-
43	报告期末股票投资余额	-	-
44	报告期末股票投资余额	-	-
45	报告期末股票投资余额	-	-
46	报告期末股票投资余额	-	-
47	报告期末股票投资余额	-	-
48	报告期末股票投资余额	-	-
49	报告期末股票投资余额	-	-
50	报告期末股票投资余额	-	-
51	报告期末股票投资余额	-	-
52	报告期末股票投资余额	-	-
53	报告期末股票投资余额	-	-
54	报告期末股票投资余额	-	-
55	报告期末股票投资余额	-	-
56	报告期末股票投资余额	-	-
57	报告期末股票投资余额	-	-
58	报告期末股票投资余额	-	-
59	报告期末股票投资余额	-	-
60	报告期末股票投资余额	-	-
61	报告期末股票投资余额	-	-
62	报告期末股票投资余额	-	-
63	报告期末股票投资余额	-	-
64	报告期末股票投资余额	-	-
65	报告期末股票投资余额	-	-
66	报告期末股票投资余额	-	-
67	报告期末股票投资余额	-	-
68	报告期末股票投资余额	-	-
69	报告期末股票投资余额	-	-
70	报告期末股票投资余额	-	-
71	报告期末股票投资余额	-	-
72	报告期末股票投资余额	-	-
73	报告期末股票投资余额	-	-
74	报告期末股票投资余额	-	-
75	报告期末股票投资余额	-	-
76	报告期末股票投资余额	-	-
77	报告期末股票投资余额	-	-
78	报告期末股票投资余额	-	-
79	报告期末股票投资余额	-	-
80	报告期末股票投资余额	-	-
81	报告期末股票投资余额	-	-
82	报告期末股票投资余额	-	-
83	报告期末股票投资余额	-	-
84	报告期末股票投资余额	-	-
85	报告期末股票投资余额	-	-
86	报告期末股票投资余额	-	-
87	报告期末股票投资余额	-	-
88	报告期末股票投资余额	-	-
89	报告期末股票投资余额	-	-
90	报告期末股票投资余额	-	-
91	报告期末股票投资余额	-	-
92	报告期末股票投资余额	-	-
93	报告期末股票投资余额	-	-
94	报告期末股票投资余额	-	-
95	报告期末股票投资余额	-	-
96	报告期末股票投资余额	-	-
97	报告期末股票投资余额	-	-
98	报告期末股票投资余额	-	-
99	报告期末股票投资余额	-	-
100	报告期末股票投资余额	-	-

注:报告期末基金资产组合中,报告期末股票投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日股票投资余额占基金资产净值的比例。

5.4 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	101800349	18 晋商银行 MTN001	100,000	10,615,000.00	9.40
2	101800361	18 晋商银行 MTN001	100,000	10,535,000.00	9.33
3	101740140	17 太钢集团 MTN002	100,000	10,418,000.00	9.23
4	101750961	17 晋商银行 MTN002	100,000	10,401,000.00	9.21
5	1700124	17 晋商银行 MTN002	100,000	10,364,000.00	9.18

注:报告期末基金资产组合中,报告期末债券投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日债券投资余额占基金资产净值的比例。

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十名股票投资明细

注:报告期末基金资产组合中,报告期末股票投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日股票投资余额占基金资产净值的比例。

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

注:报告期末基金资产组合中,报告期末资产支持证券投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日资产支持证券投资余额占基金资产净值的比例。

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

注:报告期末基金资产组合中,报告期末贵金属投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日贵金属投资余额占基金资产净值的比例。

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

注:报告期末基金资产组合中,报告期末权证投资余额占基金资产净值的比例,为报告期末每个交易日权证投资余额占基金资产净值的比例。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明,为报告期末每个交易日股指期货交易情况说明。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明,为报告期末每个交易日国债期货交易情况说明。

5.11 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

注:报告期末本基金投资的期权交易情况说明,为报告期末每个交易日期权交易情况说明。

5.12 报告期末本基金投资的资产管理计划交易情况说明

注:报告期末本基金投资的资产管理计划交易情况说明,为报告期末每个交易日资产管理计划交易情况说明。

5.13 报告期末本基金投资的私募股权投资情况说明

注:报告期末本基金投资的私募股权投资情况说明,为报告期末每个交易日私募股权投资情况说明。

5.14 报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明

注:报告期末本基金投资的衍生品交易情况说明,为报告期末每个交易日衍生品交易情况说明。

5.15 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.16 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.17 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.18 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.19 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.20 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.21 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.22 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.23 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.24 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.25 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.26 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.27 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.28 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.29 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.30 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.31 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.32 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.33 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.34 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.35 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.36 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.37 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.38 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.39 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.40 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.41 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.42 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.43 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

5.44 报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明

注:报告期末本基金投资的境外证券投资情况说明,为报告期末每个交易日境外证券投资情况说明。

基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:招商银行股份有限公司 报告送出日期:2019年4月18日	
§ 1 重要提示	
基金管理人及基金托管人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。 基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月16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。 本报告自2019年1月1日起至3月31日止。	
§ 2 基金产品概况	
基金简称	兴业鑫天盈货币
基金代码	001925
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年02月03日
报告期末基金份额总额	5,401,872,082.15份
投资目标	通过积极配置资产,在保持基金资产流动性的前提下,通过主动式管理,力求获得超过业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金根据对利率和利率变动的预测,采用投资组合平均收益率策略,在保持基金资产流动性的前提下,通过主动式管理,力求获得超过业绩比较基准的稳定回报。
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,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和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	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	兴业鑫天盈货币A
下属分级基金的代码	001925
报告期末下属分级基金的份额总额	29,444,000.00份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期2019年01月01日至2019年03月31日

兴业鑫天盈货币A 兴业鑫天盈货币B

1.本期已实现收益 27,931.80 36,350.28

2.本期公允价值变动收益 27,931.80 36,350.28

3.本期净收益 29,444.00 36,350.28

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 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

兴业鑫天盈货币A净值表现

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 0.0111% 0.0045% 0.0229% 0.0000% 0.0272% 0.0045%

兴业鑫天盈货币B净值表现

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 0.0690% 0.0046% 0.0229% 0.0000% 0.0331% 0.0046%

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。

3.2.2 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

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:2019年4月18日

§ 1 重要提示

基金管理人及基金托管人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2019年4月16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。