兴业鑫天盈货币市场基金 2019年半年度报告摘要

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

送出日期:2019年08月24日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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。

本报告期日2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业鑫天盈货币	
基金主代码	001925	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月02日	
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	
报告期末基金份额总额	3,523,182,299.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业鑫天盈货币A	兴业鑫天盈货币B
下属分级基金的交易代码	001925	001926
报告期末下属分级基金的份额总额	173,790,354.07份	3,349,391,944.97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,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		兴业基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王蕙	张燕
	联系电话	021-22211888	0755-83199084
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		40000-95561	95555
传真		021-22211997	0755-83195201

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	www.cib-fund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	兴业鑫天盈货币A	兴业鑫天盈货币B
本期已实现收益	564,722.94	67,166,944.15
本期利润	564,722.94	67,166,944.15
本期净值收益率	1.1893%	1.3072%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末基金资产净值	173,790,354.07	3,349,391,944.97
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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

兴业鑫天盈货币A

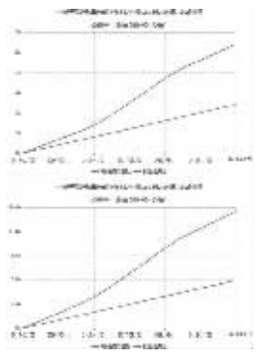
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1825%	0.0043%	0.1110%	0.0000%	0.0715%	0.0043%
过去三个月	0.5747%	0.0048%	0.3366%	0.0000%	0.2381%	0.0048%
过去六个月	1.1893%	0.0047%	0.6695%	0.0000%	0.5198%	0.0047%
过去一年	2.4491%	0.0036%	1.2500%	0.0000%	1.0991%	0.0036%
过去三年	9.4081%	0.0035%	4.0481%	0.0000%	5.3600%	0.0035%
自基金合同生效起至今	11.0521%	0.0033%	4.9414%	0.0000%	6.1107%	0.0033%

兴业鑫天盈货币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	0.2020%	0.0043%	0.1110%	0.0000%	0.0910%	0.0043%
过去三个月	0.6340%	0.0048%	0.3366%	0.0000%	0.2974%	0.0048%
过去六个月	1.3072%	0.0047%	0.6695%	0.0000%	0.6377%	0.0047%
过去一年	2.6953%	0.0036%	1.2500%	0.0000%	1.3453%	0.0036%
过去三年	10.2769%	0.0028%	4.0481%	0.0000%	6.2288%	0.0028%
自基金合同生效起至今	12.1100%	0.0027%	4.9414%	0.0000%	7.1686%	0.0027%

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

2013年3月,兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海集团投资有限公司共同出资设立,公司注册资本12亿元人民币,注册地福建省福州市。兴业基金的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。截至2019年6月30日,兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金、兴业裕丰债券型证券投资基金、兴业嘉瑞6个月定期开放债券型证券投资基金(原兴业18个月定期开放债券型证券投资基金)、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金、兴业机遇债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业安润货币市场基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业突祥混合型证券投资基金(原兴业保本混合型证券投资基金)、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业短债债券型证券投资基金(原兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金)、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(原兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金)、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业安保优选混合型证券投资基金、兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金、兴业上证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、兴业养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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		
雷志强	基金经理	2017-01-04	2019-05-28	8年	中国籍,硕士学位,特许金融分析师(CFA),注册会计师(CPA),具有证券投资基金从业资格,2011年7月至2016年5月在交通银行总行资产负债管理部工作,主要从事利率市场化研究、利率定价管理等资产负债管理相关工作,2016年6月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。
魏泰源	基金经理	2018-05-28	-	7年	中国籍,学士学位,具有证券投资基金从业资格。2012年9月至2015年8月,在中国银行司库担任利率投资团队投资经理助理,从事银行自营账户投资、交易相关工作。2015年9月至2017年7月,在招商银行金融市场部先后担任自营投资账户投资经理、自营交易账户交易员,从事银行自营账户投资、交易相关工作。2017年8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 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

基本面方面:上半年经济呈现前高后低的态势,一季度在各项刺激政策的支持下,宏观经济出现较为明显的反弹,社融增速也较2018年12月份出现明显回升;二季度政策力度整体所有弱化,经济出现一定的回调,但整体来看,宏观经济依然保持在相对正常区间,经济结构出现一定的好转,体现为消费对GDP的拉动作用越来越明显;政策方面,上半年宏观政策整体呈现逆周期调节及相机决策相结合的特点,具体来看货币政策基调保持稳健,而财政政策整体基调则相对更加较为积极,共同维持经济处于合理运行区间。

组合方面:组合在报告期内规模有所下降,7日年化保持相对稳定,上半年市场基本面整体保持稳定,货币市场流动性维持合理充裕局面,资金面情况整体平稳;6月中旬受到事件性影响,市场流动性出现一定的分层,市场流动性出现暂时的结构性分化,但随着政策面的呵护及事件的妥善解决,市场流动性重归宽裕,主要货币市场利率均有所下行;组合操作方面,上半年组合坚持流动性、安全性及收益性合理均衡的操作原则,在严控流动性风险和资产安全的情况下,取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业鑫天盈货币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1.1893%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%;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1.3072%,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

展望下半年,整体判断市场整体流动性预计依然会维持"合理充裕"的状态,但随着国内外形势及经济情况的变化,政策将更加注重预调微调,政策的侧重点或重新回归到金融供给侧改革、疏通货币政策传导路径上来,资金面或将较上半年面对更大的波动幅度,边际上或有一定的收敛。组合操作方面,组合将继续坚持流动性、安全性及收益性的合理权衡,加强对宏观利率走势的研判,做好组合的流动性管理,监控各项指标,确保安全合规运作,在确保流动性和安全性的前提下,兼顾好收益性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1)公司方面

估值委员会设主任委员一名,由分管运营的公司领导担任;委员若干名,由基金运营部、风险管理总部、研究部、投资管理总部(视会议议题内容选择相关投资方向部门)部门负责人或其指定人员组成。

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。

(2)托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

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564,722.94元,向B级份额持有人分配利润67,166,944.15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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:兴业鑫天盈货币市场基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	1,154,317,155.64	4,092,018,494.52
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,506,659,601.15	1,765,637,779.57
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,506,659,601.15	1,765,637,779.57
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,042,761,524.15	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,345,814.35	41,983,260.34
应收股利	-	-
应收申购款	450,334.22	500.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,721,534,429.51	5,899,640,034.43
负债和所有者权益	本期末 2019年06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	-	-
卖出回购金融资产款	196,583,526.72	614,791,557.81
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,118,795.00	2,506,451.40
应付托管费	169,514.38	379,765.37
应付销售服务费	72,153.10	76,498.57
应付交易费用	87,126.47	175,388.77
应交税费	4,784.89	27,747.48
应付利息	30,889.85	349,959.80
应付利润	170,202.16	368,779.27
递延所得税负债	-	-
其他负债	115,137.90	369,000.00
负债合计	198,352,130.47	619,045,136.47
所有者权益:		
实收基金	3,523,182,299.04	5,280,594,897.96
未分配利润	-	-
所有者权益合计	3,523,182,299.04	5,280,594,897.96
负债和所有者权益总计	3,721,534,429.51	5,899,640,034.43

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.000元,基金份额总额3,523,182,299.04份,其中A类基金份额173,790,354.07份,B类基金份额3,349,391,944.97份。

6.2 利润表

会计主体:兴业鑫天盈货币市场基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	83,242,643.90	551,149,005.67
1.利息收入	76,920,457.02	539,715,332.68
其中:存款利息收入	34,433,625.45	247,569,442.06
债券利息收入	23,344,856.38	215,843,187.21
资产支持证券利息收入	-	3,253,041.48
买入返售金融资产收入	19,141,975.19	73,049,661.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	6,322,186.88	11,433,672.99
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,322,186.88	11,431,889.08
资产支持证券投资收益	-	1,783.91
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	15,510,976.81	54,970,895.49
1. 管理人报酬	8,606,657.09	41,901,287.17
2. 托管费	1,304,038.93	6,348,679.87
3. 销售服务费	322,880.38	1,276,371.27
4. 交易费用	170.00	1,251.89
5. 利息支出	5,099,295.41	4,976,294.51
其中:卖出回购金融资产支出	5,099,295.41	4,976,294.51
6. 税金及附加	14,669.33	180,014.12
7. 其他费用	163,265.67	285,996.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	67,731,667.09	496,178,110.18
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	67,731,667.09	496,178,110.18

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴业鑫天盈货币市场基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	5,280,594,897.96	-	5,280,594,897.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	67,731,667.09	67,731,667.09
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)	-1,757,412,598.92	-	-1,757,412,598.92
其中:1.基金申购款	6,328,728,151.21	-	6,328,728,151.21
2.基金赎回款	-8,086,140,750.13	-	-8,086,140,750.13
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)	-	-67,731,667.09	-67,731,667.09
五、期末所有者权益(基金净值)	3,523,182,299.04	-	3,523,182,299.04
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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)	20,218,150,380.52	-	20,218,150,380.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	496,178,110.18	496,178,110.18
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)	-8,403,236,126.20	-	-8,403,236,126.20
其中:1.基金申购款	58,654,927,492.46	-	58,654,927,492.46
2.基金赎回款	-67,058,163,618.66	-	-67,058,163,618.66
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)	-	-496,178,110.18	-496,178,110.18
五、期末所有者权益(基金净值)	11,814,914,254.32	-	11,814,914,254.32

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	庄季强	楼怡斐
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

兴业鑫天盈货币市场基金(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》、《兴业鑫天盈货币市场基金基金合同》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]2102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200,030,204.66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1582号的验资报告。《兴业鑫天盈货币市场基金基金合同》(以下简称"基金合同")于2015年11月2日正式生效。本基金的管理人为兴业基金管理有限公司,托管人为招商银行股份有限公司。

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"兴业鑫天盈货币A")和B类基金份额(以下简称"兴业鑫天盈货币B")两类份额。其中,兴业鑫天盈货币A是指按照0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别;兴业鑫天盈货币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,本基金投资于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采用: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关于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。

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有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019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

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。

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 差错更正的说明

本基金在本报告期内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]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股票、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。

6.4.7.2 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
招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")	基金托管人、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: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。

6.4.8 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

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。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 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01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,606,657.09	41,901,287.17
其中:支付销售机构的客户维护费	85,450.58	811.71

注:1、支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值×0.33%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:

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%÷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01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,304,038.93	6,348,679.87

注:1、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。

6.4.8.2.3 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01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业鑫天盈货币A	兴业鑫天盈货币B	合计
兴业基金	4,305.78	250,794.62	255,100.40
兴业银行	0.00	0.00	0.00
招商银行	57,516.93	149.14	57,666.07
合计	61,822.71	250,943.76	312,766.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业鑫天盈货币A	兴业鑫天盈货币B	合计
兴业基金	5,965.26	1,269,364.84	1,275,330.10
兴业银行	0.00	0.00	0.00
招商银行	945.99	0.00	945.99
合计	6,911.25	1,269,364.84	1,276,276.09

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间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。

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位:份

兴业鑫天盈货币B

关联方名称	本期末 2019年06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
兴业银行	915,524,238.33	25.99%	2,526,375,038.51	21.38%

注: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。

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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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
招商银行	149,317,155.64	214,659.20	32,143,536.05	318,929.62
兴业银行	0.00	1,859,583.61	1,250,000,000.00	61,560,805.56

注:1、本基金的活期银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

2、本基金本报告期存放于关联方的协议存款按银行约定利率计息。

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。

6.4.8.7 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未发生无其他关联方交易事项。

6.4.9 期末(2019年06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/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 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196,583,526.72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
160016	16附息国债16	2019-07-01	100.00	600,000	60,002,768.10
199914	19贴现国债14	2019-07-01	99.92	100,000	9,991,655.99
199917	19贴现国债17	2019-07-01	99.83	696,000	69,480,683.92
199918	19贴现国债18	2019-07-01	99.74	500,000	49,871,543.63
199921	19贴现国债21	2019-07-01	99.63	300,000	29,890,488.46
合计				2,196,000	219,237,140.10

6.4.9.3.2 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证券款余额。

6.4.10 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	1,506,659,601.15	40.48
	其中:债券	1,506,659,601.15	40.48
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,042,761,524.15	28.02
	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	1,154,317,155.64	31.02
4	其他各项资产	17,796,148.57	0.48
5	合计	3,721,534,429.51	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	7.95	
	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	196,583,526.72	5.58
	其中:买断式回购融资	-	-

注: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。