兴业安润货币市场基金

2026年第2季度报告

2026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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2026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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年07月17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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业安润货币	
基金主代码	004216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年01月06日	
报告期末基金份额总额	93,262,494,540.34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	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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业安润货币A	兴业安润货币B
下属分级基金的交易代码	004216	004217

报告期末下属分级基金的份额总额	3,628,063,381.86份	89,634,431,158.48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(2026年04月01日 - 2026年06月30日)	
	兴业安润货币A	兴业安润货币B
1.本期已实现收益	12,011,443.34	308,190,479.37
2.本期利润	12,011,443.34	308,190,479.37
3.期末基金资产净值	3,628,063,381.86	89,634,431,158.48

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

兴业安润货币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	0.3281%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	-0.0085%	0.0003%
过去六个月	0.6752%	0.0003%	0.6695%	0.0000%	0.0057%	0.0003%
过去一年	1.4039%	0.0003%	1.3500%	0.0000%	0.0539%	0.0003%
过去三年	5.3238%	0.0012%	4.0500%	0.0000%	1.2738%	0.0012%
过去五年	9.5438%	0.0012%	6.7500%	0.0000%	2.7938%	0.0012%
过去七年	14.5677%	0.0014%	9.4500%	0.0000%	5.1177%	0.0014%
自基金合同生效起至今	25.2217%	0.0025%	12.8010%	0.0000%	12.4207%	0.0025%

注：1、本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。

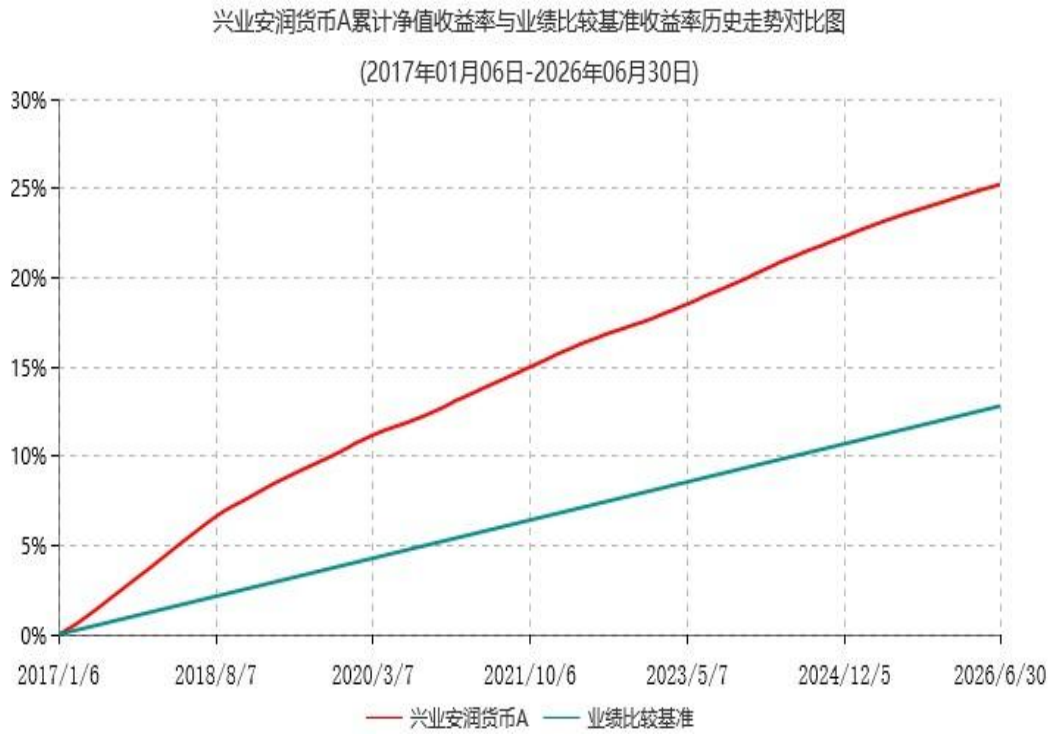
2、本基金收益分配为按日结转份额。

兴业安润货币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	0.3331%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	-0.0035%	0.0003%
过去六个月	0.6852%	0.0003%	0.6695%	0.0000%	0.0157%	0.0003%
过去一年	1.4242%	0.0003%	1.3500%	0.0000%	0.0742%	0.0003%
过去三年	5.3454%	0.0011%	4.0500%	0.0000%	1.2954%	0.0011%
过去五年	10.0568%	0.0013%	6.7500%	0.0000%	3.3068%	0.0013%
过去七年	15.6586%	0.0016%	9.4500%	0.0000%	6.2086%	0.0016%
自基金合同生效起至今	27.1664%	0.0027%	12.8010%	0.0000%	14.3654%	0.0027%

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





§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘禹含	基金经理	2024-01-12	-	12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。
宁瑶	基金经理	2024-12-17	-	10年	中国籍，华东师范大学金融学硕士学历，具有证券投资基金从业资格。2017年12月加入兴业基金管理有限公司，先后担任交易部债券交易岗、固定收益投资部专户

					投资经理助理、固定收益投资部基金经理助理。

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 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

报告期内，从海外情况来看，地缘冲突带动原油价格上涨，通胀压力升温，促使主要发达经济体货币政策由降息预期转为加息预期，资产价格对全球流动性收敛预期做出反应；国内方面，经济K型分化加剧，传统经济走弱、私人部门持续去杠杆，资金面呈现“自发式”宽松格局，资金价格中枢下移。但中东冲突推升输入性通胀，叠加全球AI资本开支扩张带动PPI回暖，央行适度回收流动性、优化政策工具，流动性管理更趋精细化，资金价格向政策利率靠拢，为完善短端利率调控机制，央行推出隔夜OMO政策工具，也将临时隔夜正回购利率走廊区间从7D逆回购利率【-20bp，+50bp】收窄为【-25bp，+25bp】。资产价格表现方面，债市呈现利差压缩行情，收益表现为中长信用债>政金债>国债，超长端受供给扰动与通胀预期影响仅存阶段性机会。

报告期内，根据市场情况综合比较各类资产的性价比，灵活调整组合的久期和杠杆水平以及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

截至报告期末兴业安润货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.3281%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%；截至报告期末兴业安润货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.3331%，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	42,532,806,384.42	41.11
	其中：债券	42,532,806,384.42	41.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	33,410,501,342.69	32.29
	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	27,517,471,132.50	26.60
4	其他资产	158,506.13	0.00
5	合计	103,460,937,365.74	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	-	5.70
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	10,177,657,551.39	10.91
	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。

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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
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。

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	50.85	10.91
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.27	-
2	30天(含)—60天	10.63	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	6.03	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	9.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	33.91	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		110.74	10.91

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,129,939,709.83	5.50
	其中：政策性金融债	4,248,067,173.56	4.55
4	企业债券	466,440,507.99	0.50
5	企业短期融资券	13,132,609,208.10	14.08
6	中期票据	491,275,986.25	0.53
7	同业存单	23,312,540,972.25	25.00
8	其他	-	-
9	合计	42,532,806,384.42	45.61
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	255,067,898.77	0.27

5.6 报告期末按公允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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09240202	24国开清发02	14,000,000	1,412,816,385.06	1.51
2	112603134	26农业银行CD134	10,000,000	994,055,297.42	1.07
3	112605180	26建设银行CD180	10,000,000	989,217,035.54	1.06
4	112603108	26农业银行CD108	9,500,000	944,857,602.88	1.01
5	09250412	25农发清发12	7,500,000	753,925,118.75	0.81
6	112621022	26渤海银行CD022	7,500,000	749,293,418.14	0.80
7	112614106	26江苏银行CD106	6,000,000	593,992,782.87	0.64
8	112602054	26工商银行CD054	5,500,000	543,550,767.98	0.58
9	112690665	26苏州银行CD007	5,000,000	499,573,788.66	0.54

10	112603076	26农业银行CD076	5,000,000	497,803,044.15	0.53

5.7 “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	0.0381%
报告期内偏离度的最低值	0.0137%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0286%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到央行江苏省分行的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、央行的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、央行的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到央行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，基金管理人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	151,218.70
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	7,287.43
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	158,506.13

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	兴业安润货币A	兴业安润货币B
报告期期初基金份额总额	3,421,641,844.89	68,491,237,568.74
报告期期间基金总申购份额	3,081,472,915.74	330,436,245,234.03
报告期期间基金总赎回份额	2,875,051,378.77	309,293,051,644.29
报告期期末基金份额总额	3,628,063,381.86	89,634,431,158.48

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	转换入	2026-04-08	13,432,413.04	13,432,413.04	0
2	申购	2026-04-14	110,000,000.00	110,000,000.00	0
3	转换入	2026-04-23	20,213,734.18	20,213,734.18	0
4	赎回	2026-06-25	-179,000,000.00	-179,000,000.00	0
5	红利再投	-	480,741.32	-	0
合计			-34,873,111.46	-35,353,852.78	

注：本基金收益分配为按日结转份额，列示在“红利再投”项下一并披露。

§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

为更好地保障基金份额持有人利益，根据有关法律法规及基金合同、托管协议的规定，兴业基金管理有限公司经与旗下相关公开募集证券投资基金基金托管人协商一致，决定调整兴业安润货币市场基金的清算交收中的申购赎回资金结算安排。同时，对兴业安润货币市场基金的托管协议中涉及清算交收中的申购赎回资金结算安排的相关条款进行修改，并更新托管协议中的基金管理人及基金托管人基本信息。上述变更事项的调整，自2026年5月23日起生效。

§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安润货币市场基金募集注册的文件

（二）《兴业安润货币市场基金基金合同》

（三）《兴业安润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

除上述第（六）项文件存放于基金托管人处外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处，投资人在办公时间内可供免费查阅。

9.3 查阅方式

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

2026年07月21日