

# 兴业安润货币市场基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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

送出日期:2023 年 03 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。基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月28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。

本报告期自2022年1月1日起至2022年12月31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、基金净值表现及利润分配情况                  | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 6  |
| 3.2 基金净值表现                               | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                        | 10 |
| §4 管理人报告                                 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                         | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明               | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 12 |
| 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              | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 14 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                  | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 15 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 15 |
| 4.9 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        | 15 |
| §5 托管人报告                                 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见        | 16 |
| §6 审计报告                                  | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息                             | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容                            | 16 |
| §7 年度财务报表                                | 19 |
| 7.1 资产负债表                                | 19 |
| 7.2 利润表                                  | 21 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                         | 23 |
| 7.4 报表附注                                 | 25 |
| §8 投资组合报告                                | 55 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                           | 55 |
| 8.2 债券回购融资情况                             | 56 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 56 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明          | 57 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 57 |
| 8.6 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 | 58 |
| 8.7 “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       | 59 |
| 8.8 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   | 59 |
| 8.9 投资组合报告附注                             | 59 |
| §9 基金份额持有人信息                             | 60 |

|  |    |
|--|----|
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 61 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....             | 61 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 62 |
| 9.4 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 .....   | 62 |
| §10 开放式基金份额变动 .....                      | 62 |
| §11 重大事件揭示 .....                         | 63 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 63 |
| 11.2 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 .....   | 63 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 63 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 63 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 63 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 63 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 64 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....              | 65 |
| 11.9 其他重大事件 .....                        | 65 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 66 |
| 12.1 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 ..... | 66 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 66 |
| §13 备查文件目录 .....                         | 66 |
| 13.1 备查文件目录 .....                        | 66 |
| 13.2 存放地点 .....                          | 67 |
| 13.3 查阅方式 .....                          | 67 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称            | 兴业安润货币市场基金         |                    |
| 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        |                    |
| 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     |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 47,478,698,480.38份 |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                    |
| 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 | 23,888,746.87份     | 47,454,809,733.51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 | 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露 姓名 | 张玲菡        | 朱萍             |

|        |      |                         |                    |
|--------|------|-------------------------|--------------------|
| 露负责人   | 联系电话 | 021-22211888            | 021-61618888       |
|        | 电子邮箱 | zhaoyue@cib-fund.com.cn | zhup02@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 40000-95561             | 95528              |
| 传真     |      | 021-22211997            | 021-63602540       |
| 注册地址   |      | 福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼 | 上海市中山东一路12号        |
| 办公地址   |      | 上海市浦东新区银城路167号13、14层    | 上海市北京东路689号        |
| 邮政编码   |      | 200120                  | 200001             |
| 法定代表人  |      | 官恒秋                     | 郑杨                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                      |
|---------------------|----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cib-fund.com.cn  |
| 基金年度报告备置地点          | 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                 |
|--------|--------------------|----------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市延安东路222号外滩中心30楼   |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2022年 |     | 2021年 |     | 2020年 |     |
|---------------|-------|-----|-------|-----|-------|-----|
|               | 兴业安   | 兴业安 | 兴业安   | 兴业安 | 兴业安   | 兴业安 |
|               |       |     |       |     |       |     |

|                      | 润货币<br>A      | 润货币B              | 润货币<br>A      | 润货币B              | 润货币<br>A      | 润货币B              |
|----------------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|
| 本期已实现收益              | 631,888.28    | 1,288,030,914.52  | 789,761.18    | 1,090,579,883.62  | 508,710.26    | 1,389,896,809.43  |
| 本期利润                 | 631,888.28    | 1,288,030,914.52  | 789,761.18    | 1,090,579,883.62  | 508,710.26    | 1,389,896,809.43  |
| 本期净值收益率              | 1.8236%       | 2.0687%           | 2.2502%       | 2.4961%           | 2.1434%       | 2.3891%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2022年末        |                   | 2021年末        |                   | 2020年末        |                   |
| 期末基金资产净值             | 23,888,746.87 | 47,454,809,733.51 | 38,402,368.74 | 41,771,866,086.64 | 38,227,301.36 | 44,330,925,931.04 |
| 期末基金份额净值             | 1.0000        | 1.0000            | 1.0000        | 1.0000            | 1.0000        | 1.0000            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2022年末        |                   | 2021年末        |                   | 2020年末        |                   |
| 累计净值收益率              | 17.7206%      | 19.4224%          | 15.6123%      | 17.0019%          | 13.0680%      | 14.1526%          |

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

| 阶段    | 份额净值<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.4150%      | 0.0008%             | 0.3403%            | 0.0000%                   | 0.0747% | 0.0008% |
| 过去六个月 | 0.8254%      | 0.0007%             | 0.6805%            | 0.0000%                   | 0.1449% | 0.0007% |
| 过去一年  | 1.8236%      | 0.0010%             | 1.3500%            | 0.0000%                   | 0.4736% | 0.0010% |
| 过去三年  | 6.3465%      | 0.0014%             | 4.0500%            | 0.0000%                   | 2.2965% | 0.0014% |

|            |          |         |         |         |         |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去五年       | 13.1804% | 0.0022% | 6.7500% | 0.0000% | 6.4304% | 0.0022% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.7206% | 0.0026% | 8.0815% | 0.0000% | 9.6391% | 0.0026% |

注：本基金业绩比较基准为：七天通知存款基准利率（税后）。

兴业安润货币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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.4760%  | 0.0008%     | 0.3403%    | 0.0000%       | 0.1357%  | 0.0008% |
| 过去六个月      | 0.9477%  | 0.0007%     | 0.6805%    | 0.0000%       | 0.2672%  | 0.0007% |
| 过去一年       | 2.0687%  | 0.0010%     | 1.3500%    | 0.0000%       | 0.7187%  | 0.0010% |
| 过去三年       | 7.1158%  | 0.0014%     | 4.0500%    | 0.0000%       | 3.0658%  | 0.0014% |
| 过去五年       | 14.5478% | 0.0022%     | 6.7500%    | 0.0000%       | 7.7978%  | 0.0022% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.4224% | 0.0026%     | 8.0815%    | 0.0000%       | 11.3409% | 0.0026% |

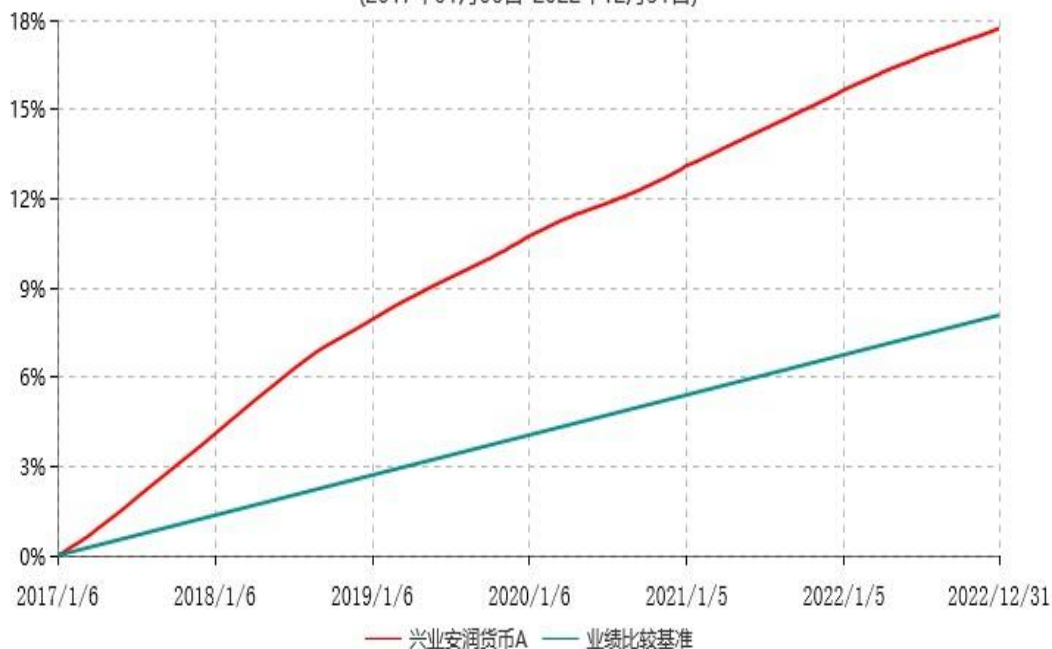
注：本基金业绩比较基准为：七天通知存款基准利率（税后）。

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



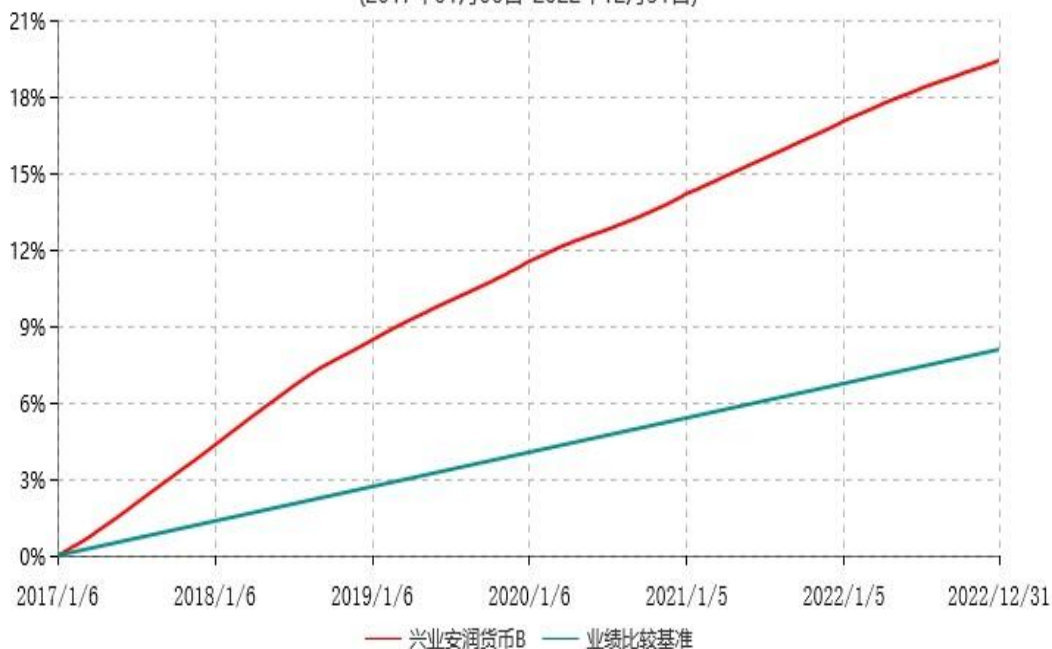
兴业安润货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年01月06日-2022年12月31日)

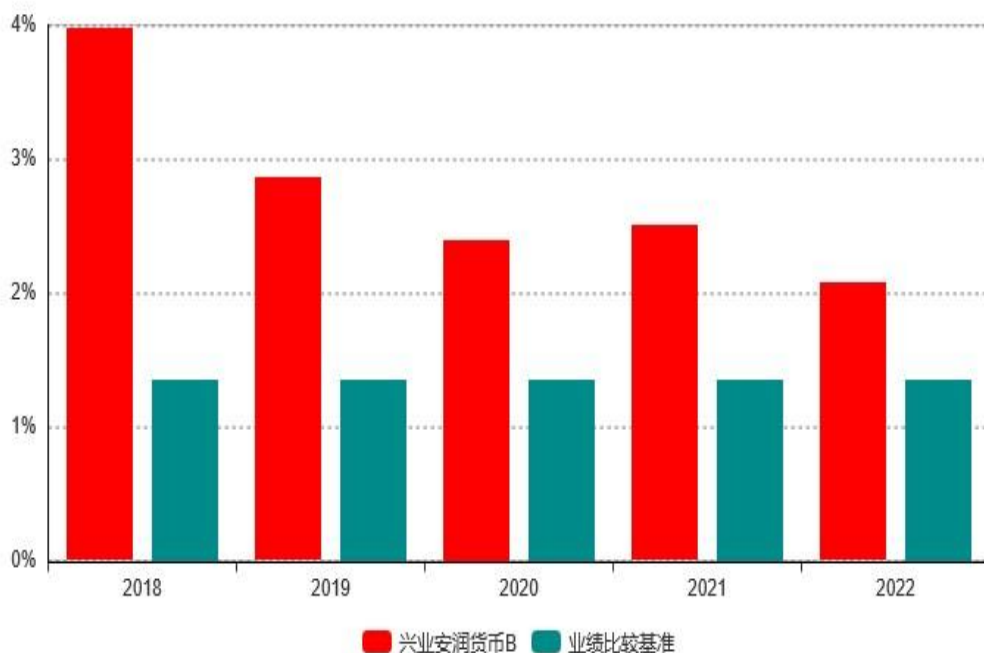
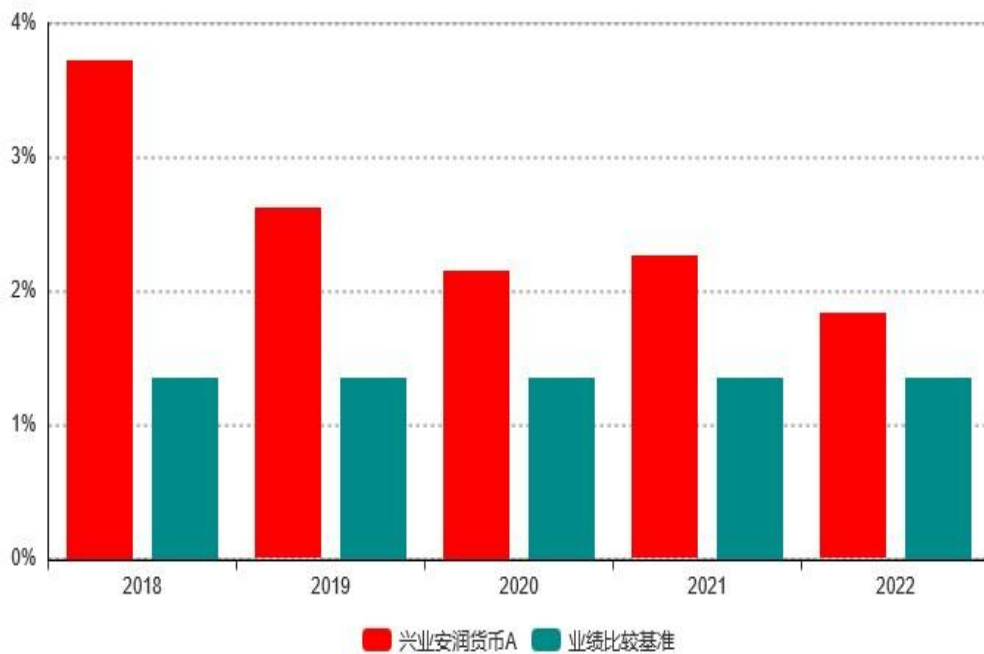


兴业安润货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年01月06日-2022年12月31日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

兴业安润货币A

单位：人民币元

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计     | 备注 |
|-------|--------------|---------------|----------|--------------|----|
| 2022年 | 631,888.28   | -             | -        | 631,888.28   | -  |
| 2021年 | 789,761.18   | -             | -        | 789,761.18   | -  |
| 2020年 | 508,710.26   | -             | -        | 508,710.26   | -  |
| 合计    | 1,930,359.72 | -             | -        | 1,930,359.72 | -  |

兴业安润货币B

单位：人民币元

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计         | 备注 |
|-------|------------------|---------------|----------|------------------|----|
| 2022年 | 1,288,030,914.52 | -             | -        | 1,288,030,914.52 | -  |
| 2021年 | 1,090,579,883.62 | -             | -        | 1,090,579,883.62 | -  |
| 2020年 | 1,389,896,809.43 | -             | -        | 1,389,896,809.43 | -  |
| 合计    | 3,768,507,607.57 | -             | -        | 3,768,507,607.57 | -  |

## §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，兴业基金坚守“受人之托、代客理财”的初心本源，坚守“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，以“市场化、专业化、数字化”为转型方向，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12月31日，兴业基金共管理84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 |        |   |
| 雷志强 | 固定收益投资部货币与利率投资团队副总监，基金经理 | 2018-06-05      | -    | 11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，现任固定收益投资部货币与利率投资团队副总监，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《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2022年初以来，受疫情和地产领域流动性压力的持续拖累，国内经济景气度指标、经济和金融数据延续下行趋势，国内经济整体面临“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力，宏观政策发力稳增长，货币政策维持宽松基调，流动性保持合理充裕。11月之后，防疫政策优化以及地产托底政策密集出台，困扰全年经济的两大因素预期明显改善，国内债券市场交易主线由“弱经济现实”迅速切换至“强预期”，收益率曲线快速平坦化上行，资管产品尤其是银行理财产品净值大幅回撤，个人投资者集中赎回，进而引发产品负债端赎回--资产端卖出债券--收益率快速上行--组合净值下跌--赎回加剧的负反馈机制，债券市场剧烈波动上行。全年来看，债券收益率呈V型走势，利率债较上年末下行，信用债整体上行，不同品种的信用利差走阔；从货币市场流动性看，报告期内，流动性总体仍保持充裕状态，货币市场品种中，1年AAA-同业存单利率较上年末下行13bp。

报告期内本基金投资运作上，注重做好年内各时点的流动性安排；在投资运作上，做好组合负债管理的前提下，根据市场利率走势，稳步布局跨年资产，在品种上根据信用债、同业存单存款、资产支持证券和回购资产等收益利差进行权衡配置，在确保流动性安全前提下提高组合跨年资产配置收益。

#### 4.4.2 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1.00元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.8236%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%；截至报告期末兴业安润货

币B基金份额净值为1.00元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为2.0687%，同期业绩比较基准收益率为1.3500%。

#### 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2023年，随着疫情对于经济的拖累效应下降，地产行业流动性预期改善，预计经济整体呈弱复苏格局。在经济内生动力处于修复期，而全年经济增长目标诉求较强的政策函数下，预计宏观政策相机决策的特征更加明显，国内债券市场将随着经济增长预期的强弱整体呈现利率波动行情，全年来看，资金和利率中枢可能会有所上行，信用优于利率品种。在未来产品运作上，管理人将继续加强宏观经济走势及货币市场利率研判，严格做好组合负债管理，加强配置布局和交易获利能力，力争在兼顾流动性和安全性的前提下提高组合收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，2022年度主要从如下几个方面落实风险控制与合规管理、强化监察稽核职能：

1、建立健全公司治理结构、完善制度流程：报告期内公司持续优化公司治理和内部控制环境，紧跟监管导向深入落实行业高质量发展意见要求，完成监管新规内化落地工作，持续完善制度体系和授权管理机制，结合业务发展情况持续健全内部控制体系；

2、加强业务合规及信息披露审核：随着公司管理资产规模扩大以及产品线进一步丰富，公司持续加强对信息披露材料、营销材料、产品方案等开展合规审核，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，保证各项对外营销活动和宣传推介合法合规；

3、全面实施投资监督和风险监控：公司严格遵照法律法规、基金合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制基金运作风险。

4、开展各项稽核审计工作：根据法规要求，组织开展定期稽核、特定人员离任审计，依据风险导向组织重点业务领域专项审计，根据监管要求组织各项自查，对公司治理、投资研究、产品运作、业务开展合规性及内控完善性进行审查，不断促进公司内控制度执行有效。

5、落实全员合规理念、加强员工合规管理：报告期内公司持续开展外规宣贯和培训，密切关注外部监管要求，重视外规要求传达与内化，通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规内控意识；严格规范工作人员执业行为，开展警示案防教育，督促员工勤勉尽责，防范利用职务便利从事违法违规、超越权限或者其他损害客户合法权益的行为；组织开展定期常规信息管制抽查，以及异常行为专项排查，加强员工行为监督，强化员工合规管理。

6、持续完善内控合规体系建设、强化合规内控管理：报告期内，持续推进合规内控文化建设，完善法治管理体系，优化合规内控评价机制，强化合规引导，推进重点法规内化落地，有序开展各项合规内控工作，不断提升公司审慎规范经营和全面风险管理水平。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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631,888.28元，向B级份额持有人分配利润1,288,030,914.52元。

#### 4.9 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对兴业安润货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对兴业安润货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由兴业基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                   |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见             |
| 审计报告编号     | 德师报(审)字(23)第P00903号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|         |  |
|---------|--|
| 审计报告标题  | 审计报告   |
| 审计报告收件人 | 兴业安润货币市场基金全体持有人  |
| 审计意见    | 我们审计了兴业安润货币市场基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产(资产净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴业安润货币市场基金2022 |



|                        |   |
|------------------------|---|
|                        | <p>年12月31日的财务状况、2022年度的经营成果和资产净值变动情况。</p>   |
| <p>形成审计意见的基础</p>       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴业安润货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>  |
| <p>强调事项</p>            | <p>-</p>  |
| <p>其他事项</p>            | <p>-</p>  |
| <p>其他信息</p>            | <p>兴业基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括兴业安润货币市场基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴业安润货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴业安润货币市场基金、终止运营或别无其他</p>  |

|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>现实的选择。基金管理人治理层负责监督兴业安润货币市场基金的财务报告过程。</p>  |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴业安润货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴业安润货币市场基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报</p> |

|           |  |    |
|-----------|--|----|
|           | 表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |    |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)   |    |
| 注册会计师的姓名  | 汪芳   | 王硕 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市延安东路222号外滩中心30楼   |    |
| 审计报告日期    | 2023-03-28   |    |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴业安润货币市场基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 10,715,730,838.06  | 16,674,039,029.57   |
| 结算备付金      |         | 702,912,378.61     | 203,086,589.82      |
| 存出保证金      |         | 53,456.63          | 40,111.08           |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 25,340,539,042.33  | 18,444,414,215.30   |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 23,005,019,933.95  | 16,312,398,618.15   |
| 资产支持证券投资   |         | 2,335,519,108.38   | 2,132,015,597.15    |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产   | 7.4.7.4 | 14,829,430,462.30  | 9,854,566,560.46    |
| 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         |            | 442,171,011.37             | 10,087,581.78               |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 15,000,000.00              | 4,700.00                    |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | 179,848,646.42              |
| 资产总计          |            | 52,045,837,189.30          | 45,366,087,434.43           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | 4,553,231,287.86           | 3,544,736,248.49            |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 7,886,914.51               | 5,969,898.78                |
| 应付托管费         |            | 4,206,354.43               | 3,183,946.03                |
| 应付销售服务费       |            | 530,913.67                 | 407,565.34                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 393,650.68                 | 613,391.50                  |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.6    | 889,587.77                 | 907,928.91                  |
| 负债合计          |            | 4,567,138,708.92           | 3,555,818,979.05            |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |

|          |         |                   |                   |
|----------|---------|-------------------|-------------------|
| 实收基金     | 7.4.7.7 | 47,478,698,480.38 | 41,810,268,455.38 |
| 其他综合收益   |         | -                 | -                 |
| 未分配利润    | 7.4.7.8 | -                 | -                 |
| 净资产合计    |         | 47,478,698,480.38 | 41,810,268,455.38 |
| 负债和净资产总计 |         | 52,045,837,189.30 | 45,366,087,434.43 |

注：1、报告截止日2022年12月31日，基金份额净值1.00元，基金份额总额47,478,698,480.38份，其中A类基金份额23,888,746.87份，B类基金份额47,454,809,733.51份。

2、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：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。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业安润货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2022年01月01日至2<br>022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2<br>021年12月31日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入          |          | 1,496,795,236.05                  | 1,237,269,427.25                       |
| 1.利息收入           |          | 861,756,679.34                    | 1,225,663,845.98                       |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.9  | 408,726,177.32                    | 374,784,780.87                         |
| 债券利息收入           |          | -                                 | 518,925,330.53                         |
| 资产支持证券利息收入       |          | -                                 | 65,265,324.81                          |
| 买入返售金融资产收入       |          | 453,030,502.02                    | 266,688,409.77                         |
| 其他利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) |          | 634,943,715.54                    | 11,593,438.29                          |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.10 | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益           |          | -                                 | -                                      |

|                            |            |                  |                  |
|----------------------------|------------|------------------|------------------|
| 债券投资收益                     | 7.4.7.11   | 568,938,456.62   | 11,593,438.29    |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.12   | 66,005,258.92    | -                |
| 贵金属投资收益                    |            | -                | -                |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.13   | -                | -                |
| 股利收益                       | 7.4.7.14   | -                | -                |
| 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）      | 7.4.7.15   | -                | -                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -                | -                |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.16   | 94,841.17        | 12,142.98        |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 208,132,433.25   | 145,899,782.45   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 95,787,427.96    | 66,673,443.94    |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 51,086,628.36    | 38,873,368.77    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 6,468,678.28     | 4,529,942.94     |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                | -                |
| 5. 利息支出                    |            | 53,983,450.78    | 34,832,011.76    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 53,983,450.78    | 34,832,011.76    |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.17   | -                | -                |
| 7. 税金及附加                   |            | 434,594.32       | 636,199.48       |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.18   | 371,653.55       | 354,815.56       |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 1,288,662,802.80 | 1,091,369,644.80 |
| 减：所得税费用                    |            | -                | -                |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 1,288,662,802.80 | 1,091,369,644.80 |
| <b>五、其他综合收益的税后净</b>        |            | -                | -                |

|          |  |                  |                  |
|----------|--|------------------|------------------|
| 额        |  |                  |                  |
| 六、综合收益总额 |  | 1,288,662,802.80 | 1,091,369,644.80 |

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：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。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴业安润货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31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）      | 41,810,268,455.38             | -      | -                | 41,810,268,455.38 |
| 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）      | 41,810,268,455.38             | -      | -                | 41,810,268,455.38 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 5,668,430,025.00              | -      | -                | 5,668,430,025.00  |
| （一）、综合收益总额           | -                             | -      | 1,288,662,802.80 | 1,288,662,802.80  |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值  | 5,668,430,025.00              | -      | -                | 5,668,430,025.00  |

|  |                                    |        |                       |                         |
|--|------------------------------------|--------|-----------------------|-------------------------|
| 变动数(净值减少以“-”号填列)                         |                                    |        |                       |                         |
| 其中: 1.基金申购款                              | 135,750,905,19<br>7.74             | -      | -                     | 135,750,905,19<br>7.74  |
| 2.基金赎回款                                  | -130,082,475,17<br>2.74            | -      | -                     | -130,082,475,17<br>2.74 |
| (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) | -                                  | -      | -1,288,662,802.<br>80 | -1,288,662,802.<br>80   |
| (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)                          | 47,478,698,480.<br>38              | -      | -                     | 47,478,698,480.<br>38   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31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)                          | 44,369,153,232.<br>40              | -      | -                     | 44,369,153,232.<br>40   |
| 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)                          | 44,369,153,232.<br>40              | -      | -                     | 44,369,153,232.<br>40   |
| 三、本期增减变                                  | -2,558,884,777.                    | -      | -                     | -2,558,884,777.         |



|  |                     |   |                   |                     |
|--|---------------------|---|-------------------|---------------------|
| 动额(减少以“-”号填列)                            | 02                  |   |                   | 02                  |
| (一)、综合收益总额                               | -                   | - | 1,091,369,644.80  | 1,091,369,644.80    |
| (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)      | -2,558,884,777.02   | - | -                 | -2,558,884,777.02   |
| 其中: 1.基金申购款                              | 113,672,733,787.71  | - | -                 | 113,672,733,787.71  |
| 2.基金赎回款                                  | -116,231,618,564.73 | - | -                 | -116,231,618,564.73 |
| (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) | -                   | - | -1,091,369,644.80 | -1,091,369,644.80   |
| (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)                          | 41,810,268,455.38   | - | -                 | 41,810,268,455.38   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴业安润货币市场基金(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》、《兴业安润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[2016]2713号文批准公开募集。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200,009,654.06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(17)第00007号的验资报告。《兴业安润货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2017年1月6日正式生效。本基金的管理人为兴业基金管理有限公司,托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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“兴业安润货币A”)和B类基金份额(以下简称“兴业安润货币B”)两类份额。其中兴业安润货币A是指按照0.25%年费率计提销售服务费的基金份额类别;兴业安润货币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采用:七天通知存款利率(税后)。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

##### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。在本基金存续期间，基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后采用估值技术确定最能反映公允价值的价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

债券投资收益包括债券利息收入以及买卖债券价差收入。基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括资产支持证券利息收入以及买卖资产支持证券价差收入。基金持有的资产支持证券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

### (3)信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3)“每日分配、按日支付”。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。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4)本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5)本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，其当日净收益大于零，则为投资人增加相应的基金份额，其当日净收益为零，则保持投资人基金份额不变，若当日净收益小于零，则缩减投资人基金份额；若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

(6)当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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16,674,039,029.57元、人民币203,086,589.82元、人民币40,111.08元、人民币

9,854,566,560.46元、人民币179,848,646.42元、人民币3,544,736,248.49元、人民币385,862.69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16,743,481,106.51元、人民币203,187,117.72元、人民币40,130.88元、人民币9,859,654,987.75元、人民币0.00元、人民币3,545,122,111.18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18,444,414,215.30元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币105,217,594.49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18,549,631,809.79元。

本基金自2022年7月1日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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，暂不缴纳企业所得税。



(3)本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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 5,104,150,120.83   | 2,074,039,029.57    |
| 等于：本金        | 5,101,431,339.17   | 2,074,039,029.57    |
| 加：应计利息       | 2,718,781.66       | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 定期存款         | 5,611,580,717.23   | 14,600,000,000.00   |
| 等于：本金        | 5,600,000,000.00   | 14,600,000,000.00   |
| 加：应计利息       | 11,580,717.23      | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1个月以内 | 1,000,315,555.56   | 1,800,000,000.00    |
| 存款期限1-3个月    | 801,360,833.54     | 1,500,000,000.00    |
| 存款期限3个月以上    | 3,809,904,328.13   | 11,300,000,000.00   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 等于：本金        | -                  | -                   |
| 加：应计利息       | -                  | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 合计           | 10,715,730,838.06  | 16,674,039,029.57   |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|    |     |

|        |       | 2022年12月31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 | 10,178,902.97       | 10,147,550.69     | -31,352.28     | -0.0001 |
|        | 银行间市场 | 22,994,841,030.98   | 22,972,618,811.52 | -22,222,219.46 | -0.0468 |
|        | 合计    | 23,005,019,933.95   | 22,982,766,362.21 | -22,253,571.74 | -0.0469 |
| 资产支持证券 |       | 2,335,519,108.38    | 2,329,466,345.01  | -6,052,763.37  | -0.0127 |
| 合计     |       | 25,340,539,042.33   | 25,312,232,707.22 | -28,306,335.11 | -0.0596 |
| 项目     |       | 上年度末<br>2021年12月31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 | 360,977,568.44      | 360,286,000.00    | -691,568.44    | -0.0017 |
|        | 银行间市场 | 15,951,421,049.71   | 15,963,900,200.00 | 12,479,150.29  | 0.0298  |
|        | 合计    | 16,312,398,618.15   | 16,324,186,200.00 | 11,787,581.85  | 0.0282  |
| 资产支持证券 |       | 2,132,015,597.15    | 2,133,954,750.00  | 1,939,152.85   | 0.0046  |
| 合计     |       | 18,444,414,215.30   | 18,458,140,950.00 | 13,726,734.70  | 0.0328  |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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<br>2022年12月31日 |
|----|--------------------|
|    |                    |

|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
|-------|-------------------|-----------|
| 交易所市场 | 3,137,450,040.32  | -         |
| 银行间市场 | 11,691,980,421.98 | -         |
| 合计    | 14,829,430,462.30 | -         |
| 项目    | 上年度末              |           |
|       | 2021年12月31日       |           |
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 5,774,286,000.00  | -         |
| 银行间市场 | 4,080,280,560.46  | -         |
| 合计    | 9,854,566,560.46  | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息  | -                  | 179,848,646.42      |
| 其他应收款 | -                  | -                   |
| 待摊费用  | -                  | -                   |
| 合计    | -                  | 179,848,646.42      |

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 710,587.77         | 343,066.22          |
| 其中：交易所市场    | -                  | -                   |
| 银行间市场       | 710,587.77         | 343,066.22          |

|      |            |            |
|------|------------|------------|
| 应付利息 | -          | 385,862.69 |
| 预提费用 | 179,000.00 | 179,000.00 |
| 合计   | 889,587.77 | 907,928.91 |

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 兴业安润货币A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(兴业安润货币A) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |                 |
|-----------------|-------------------------------|-----------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末            | 38,402,368.74                 | 38,402,368.74   |
| 本期申购            | 149,591,479.70                | 149,591,479.70  |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -164,105,101.57               | -164,105,101.57 |
| 本期末             | 23,888,746.87                 | 23,888,746.87   |

##### 7.4.7.7.2 兴业安润货币B

金额单位：人民币元

| 项目<br>(兴业安润货币B) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |                     |
|-----------------|-------------------------------|---------------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额                |
| 上年度末            | 41,771,866,086.64             | 41,771,866,086.64   |
| 本期申购            | 135,601,313,718.04            | 135,601,313,718.04  |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -129,918,370,071.17           | -129,918,370,071.17 |
| 本期末             | 47,454,809,733.51             | 47,454,809,733.51   |

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。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 兴业安润货币A

单位：人民币元

| 项目<br>(兴业安润货币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           | 631,888.28  | - | 631,888.28  |
| 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        | -631,888.28 | - | -631,888.28 |
| 本期末            | -           | - | -           |

#### 7.4.7.8.2 兴业安润货币B

单位：人民币元

| 项目<br>(兴业安润货币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            | 1,288,030,914.52  | -     | 1,288,030,914.52  |
| 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         | -1,288,030,914.52 | -     | -1,288,030,914.52 |
| 本期末             | -                 | -     | -                 |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 79,573,465.08                     | 18,842,263.59                          |
| 定期存款利息收入  | 319,089,738.92                    | 348,553,373.19                         |
| 其他存款利息收入  | -                                 | -                                      |
| 结算备付金利息收入 | 10,062,102.92                     | 7,386,271.99                           |
| 其他        | 870.40                            | 2,872.10                               |

|    |                |                |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 408,726,177.32 | 374,784,780.87 |
|----|----------------|----------------|

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益——买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入                         | 573,373,800.73                    | -                                      |
| 债券投资收益——买卖债券<br>(债转股及债券到期兑付)<br>差价收入 | -4,435,344.11                     | 11,593,438.29                          |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 合计                                   | 568,938,456.62                    | 11,593,438.29                          |

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月<br>31日 |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出债券(债转股<br>及债券到期兑付)<br>成交总额    | 68,794,429,598.36                 | 63,603,178,757.10                      |
| 减: 卖出债券(债<br>转股及债券到期兑<br>付)成本总额 | 68,350,137,876.70                 | 63,076,856,213.55                      |
| 减: 应计利息总额                       | 448,726,620.15                    | 514,729,105.26                         |

|          |               |               |
|----------|---------------|---------------|
| 减：交易费用   | 445.62        | -             |
| 买卖债券差价收入 | -4,435,344.11 | 11,593,438.29 |

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------------|--|
| 资产支持证券投资收益——<br>利息收入         | 66,005,258.92                     | -                                      |
| 资产支持证券投资收益——<br>买卖资产支持证券差价收入 | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资收益——<br>赎回差价收入       | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资收益——<br>申购差价收入       | -                                 | -                                      |
| 合计                           | 66,005,258.92                     | -                                      |

##### 7.4.7.12.2 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<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|--------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出资产支持证券成交总额       | 2,676,709,500.43                  | 2,203,545,285.55                       |
| 减：卖出资产支持证券成本<br>总额 | 2,629,999,750.00                  | 2,163,206,850.00                       |
| 减：应计利息总额           | 46,709,750.43                     | 40,338,435.55                          |
| 减：交易费用             | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资收益         | -                                 | -                                      |

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 基金赎回费收入 | -                                 | -                                      |
| 其他      | 94,841.17                         | 12,142.98                              |
| 合计      | 94,841.17                         | 12,142.98                              |

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-------|-----------------------------------|--|
| 审计费用  | 50,000.00                         | 50,000.00                              |
| 信息披露费 | 120,000.00                        | 120,000.00                             |
| 汇划手续费 | 167,714.33                        | 149,613.44                             |
| 账户维护费 | 32,700.00                         | 34,720.00                              |
| 其他费用  | 1,239.22                          | -                                      |



|      |            |            |
|------|------------|------------|
| 交易费用 | -          | 482.12     |
| 合计   | 371,653.55 | 354,815.56 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

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。

| 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 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"浦发银行") | 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、基金销售机构     |
| 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            |
| 兴业国信资产管理有限公司(以下简称"兴业国信资产") | 基金管理人的控股股东控制的公司       |
| 兴银理财有限责任公司(以下简称"兴银理财")     | 基金管理人的控股股东控制的公司       |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 95,787,427.96                 | 66,673,443.94                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,017,617.22                  | 3,762,713.04                       |

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值×0.15%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×0.15%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 51,086,628.36                 | 38,873,368.77                      |

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×托管费的年费率计提，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×托管费率÷当年天数。

2、根据《关于兴业安润货币市场基金降低基金托管费率并修改基金合同、托管协议的公告》，自2021年5月18日起，本基金的托管费率由0.1%降低至0.08%。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日      |              |              |
|----------------|------------------------------------|--------------|--------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |              |              |
|                | 兴业安润货币A                            | 兴业安润货币B      | 合计           |
| 兴业基金           | 27,116.10                          | 5,527,408.22 | 5,554,524.32 |
| 兴业银行           | 0.45                               | 121,270.83   | 121,271.28   |
| 合计             | 27,116.55                          | 5,648,679.05 | 5,675,795.60 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |              |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |              |              |
|                | 兴业安润货币A                            | 兴业安润货币B      | 合计           |
| 兴业基金           | 17,087.53                          | 3,859,609.19 | 3,876,696.72 |
| 合计             | 17,087.53                          | 3,859,609.19 | 3,876,696.72 |

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。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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |      |       |      |       |      |
|----------------|-------------------------------|------|-------|------|-------|------|
|                | 债券交易金额                        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                | 基金买入                          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 浦发银行           | 390,053,600.00                | -    | -     | -    | -     | -    |
| 兴业银行           | 292,540,200.00                | -    | -     | -    | -     | -    |

| 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |                |      |       |      |       |      |
|------------------------------------|----------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                     | 债券交易金额         |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                    | 基金买入           | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 浦发银行                               | 496,869,000.00 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

兴业安润货币A

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 |
|---------------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额         | 3,779,816.27                      | 0.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额        | 68,797.31                         | 3,779,816.27                           |
| 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         | 3,848,613.58                      | 3,779,816.27                           |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 16.11%                            | 9.84%                                  |

兴业安润货币B

份额单位：份

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至<br>2021年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 报告期初持有的基金份额    | 0.00                              | 22,504,292.32                          |
| 报告期间申购/买入总份额   | 0.00                              | 31,259,518.74                          |
| 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                              | 53,763,811.06                          |
| 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% |
|---------------------|-------|-------|

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。

#### 7.4.10.4.2 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

##### 兴业安润货币A

| 关联方名称  | 本期末<br>2022年12月31日 |                  | 上年度末<br>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 |
| 兴业国信资产 | 156,422.39         | 0.65%            | 153,626.13          | 0.40%            |

##### 兴业安润货币B

| 关联方名称 | 本期末<br>2022年12月31日 |                  | 上年度末<br>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  | 157,868,119.91     | 0.33%            | 184,216,810.35      | 0.44%            |
| 浦发银行  | 2,058,095,808.73   | 4.34%            | 909,414,173.39      | 2.18%            |
| 兴银理财  | 0.00               | 0.00%            | 11,996,161.03       | 0.03%            |

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。

#### 7.4.10.5 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<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |               | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |               |
|-------|-------------------------------|---------------|------------------------------------|---------------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入        | 期末余额                               | 当期利息收入        |
| 浦发银行  | 5,104,150,120.83              | 79,573,465.08 | 2,074,039,029.57                   | 21,722,819.10 |

|      |      |               |                |               |
|------|------|---------------|----------------|---------------|
| 兴业银行 | 0.00 | 15,118,333.30 | 900,000,000.00 | 44,526,111.14 |
|------|------|---------------|----------------|---------------|

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

2、本基金本报告期及上年度可比期间存放于关联方的协议存款按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有基金管理人的股东发行的同业存单22兴业银行CD248(112210248)500,000张，占本基金资产净值的0.1041%(上年度末未持有)；

本报告期末，本基金持有托管人发行的同业存单22浦发银行CD154(112209154)500,000张，占本基金资产净值的0.1038%(上年度末未持有)。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金

兴业安润货币A

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 631,888.28       | -                 | -            | 631,888.28   | -  |

兴业安润货币B

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计     | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 1,288,030,914.52 | -                 | -            | 1,288,030,914.52 | -  |

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2022年12月31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4,553,231,287.86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         |
|-----------|-------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 112203015 | 22农业银行CD015 | 2023-01-03 | 99.50  | 1,000,000 | 99,500,176.10  |
| 112203043 | 22农业银行CD043 | 2023-01-03 | 99.04  | 1,000,000 | 99,044,750.50  |
| 112203048 | 22农业银行CD048 | 2023-01-03 | 99.00  | 1,000,000 | 98,996,000.82  |
| 112203060 | 22农业银行CD060 | 2023-01-03 | 98.79  | 1,000,000 | 98,792,555.77  |
| 112205035 | 22建设银行CD035 | 2023-01-03 | 99.44  | 1,000,000 | 99,437,965.78  |
| 112205097 | 22建设银行CD097 | 2023-01-03 | 98.94  | 3,000,000 | 296,828,758.58 |
| 112206099 | 22交通银行CD099 | 2023-01-03 | 99.39  | 1,747,000 | 173,638,735.36 |
| 112211045 | 22平安银行CD045 | 2023-01-03 | 99.33  | 500,000   | 49,666,935.75  |
| 112211057 | 22平安银行CD057 | 2023-01-03 | 99.07  | 401,000   | 39,726,371.18  |
| 112211139 | 22平安银行CD139 | 2023-01-03 | 99.43  | 700,000   | 69,598,108.68  |
| 112215238 | 22民生银行CD238 | 2023-01-03 | 98.95  | 1,900,000 | 187,998,330.95 |
| 112215430 | 22民生银行CD430 | 2023-01-03 | 99.54  | 4,000,000 | 398,154,244.21 |
| 112217134 | 22光大银行CD134 | 2023-01-03 | 98.81  | 2,000,000 | 197,616,778.87 |
| 112217148 | 22光大银行CD    | 2023-01-03 | 98.87  | 2,000,000 | 197,748,208.35 |

|           |                 |            |        |            |                  |
|-----------|-----------------|------------|--------|------------|------------------|
|           | 148             |            |        |            |                  |
| 112220173 | 22广发银行CD<br>173 | 2023-01-03 | 99.64  | 2,150,000  | 214,220,465.71   |
| 112271350 | 22晋商银行CD<br>168 | 2023-01-03 | 99.66  | 5,000,000  | 498,298,446.17   |
| 112282116 | 22南京银行CD<br>114 | 2023-01-03 | 98.90  | 5,000,000  | 494,516,197.80   |
| 112282791 | 22宁波银行CD<br>178 | 2023-01-03 | 98.79  | 2,000,000  | 197,573,919.04   |
| 112282951 | 22重庆银行CD<br>084 | 2023-01-03 | 98.76  | 3,800,000  | 375,303,064.14   |
| 160207    | 16国开07          | 2023-01-03 | 102.91 | 2,500,000  | 257,275,872.05   |
| 200407    | 20农发07          | 2023-01-03 | 101.93 | 9,480,000  | 966,324,032.77   |
| 合计        |                 |            |        | 51,178,000 | 5,110,259,918.58 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | 270,192,444.88      |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 301,654,706.99     | 2,260,126,103.51    |
| 合计     | 301,654,706.99     | 2,530,318,548.39    |

##### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 19,573,165,622.56  | 10,271,668,887.63   |
| 合计     | 19,573,165,622.56  | 10,271,668,887.63   |

#### 7.4.13.2.4 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 142,631,057.40     | 1,299,949,283.47    |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 30,674,345.78      | -                   |
| 合计     | 173,305,403.18     | 1,299,949,283.47    |

#### 7.4.13.2.5 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<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 2,335,519,108.38   | 2,132,015,597.15    |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 2,335,519,108.38   | 2,132,015,597.15    |

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金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。

#### 7.4.13.3 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%。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022年1<br>2月31<br>日 | 1年以内              | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计                |
|----------------------------|-------------------|------|------|----------------|-------------------|
| 资产                         |                   |      |      |                |                   |
| 银行存款                       | 10,715,730,838.06 | -    | -    | -              | 10,715,730,838.06 |
| 结算备付金                      | 702,912,378.61    | -    | -    | -              | 702,912,378.61    |
| 存出保证金                      | 53,456.63         | -    | -    | -              | 53,456.63         |
| 交易性金融资产                    | 25,340,539,042.33 | -    | -    | -              | 25,340,539,042.33 |
| 买入返售金融资产                   | 14,829,430,462.30 | -    | -    | -              | 14,829,430,462.30 |
| 应收清算款                      | -                 | -    | -    | 442,171,011.37 | 442,171,011.37    |
| 应收申购款                      | -                 | -    | -    | 15,000,000.00  | 15,000,000.00     |
| 资产总计                       | 51,588,666,177.93 | -    | -    | 457,171,011.37 | 52,045,837,189.30 |
| 负债                         |                   |      |      |                |                   |
| 卖出回购金融资产款                  | 4,553,231,287.86  | -    | -    | -              | 4,553,231,287.86  |
| 应付管理人报酬                    | -                 | -    | -    | 7,886,914.51   | 7,886,914.51      |
| 应付托管费                      | -                 | -    | -    | 4,206,354.43   | 4,206,354.43      |
| 应付销售服务费                    | -                 | -    | -    | 530,913.67     | 530,913.67        |
| 应交税费                       | -                 | -    | -    | 393,650.68     | 393,650.68        |
| 其他负债                       | -                 | -    | -    | 889,587.77     | 889,587.77        |
| 负债总计                       | 4,553,231,287.86  | -    | -    | 13,907,421.06  | 4,567,138,708.92  |
| 利率敏感度缺口                    | 47,035,434,890.07 | -    | -    | 443,263,590.31 | 47,478,698,480.38 |
| 上年度                        | 1年以内              | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计                |

|                              |                   |   |   |                |                   |
|------------------------------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 末<br>2021 年 1<br>2 月 31<br>日 |                   |   |   |                |                   |
| 资产                           |                   |   |   |                |                   |
| 银行存款                         | 16,674,039,029.57 | - | - | -              | 16,674,039,029.57 |
| 结算备付金                        | 203,086,589.82    | - | - | -              | 203,086,589.82    |
| 存出保证金                        | 40,111.08         | - | - | -              | 40,111.08         |
| 交易性金融资产                      | 18,444,414,215.30 | - | - | -              | 18,444,414,215.30 |
| 买入返售金融资产                     | 9,854,566,560.46  | - | - | -              | 9,854,566,560.46  |
| 应收证券清算款                      | -                 | - | - | 10,087,581.78  | 10,087,581.78     |
| 应收利息                         | -                 | - | - | 179,848,646.42 | 179,848,646.42    |
| 应收申购款                        | -                 | - | - | 4,700.00       | 4,700.00          |
| 资产总计                         | 45,176,146,506.23 | - | - | 189,940,928.20 | 45,366,087,434.43 |
| 负债                           |                   |   |   |                |                   |
| 卖出回购金融资产款                    | 3,544,736,248.49  | - | - | -              | 3,544,736,248.49  |
| 应付管理人报酬                      | -                 | - | - | 5,969,898.78   | 5,969,898.78      |
| 应付托管费                        | -                 | - | - | 3,183,946.03   | 3,183,946.03      |
| 应付销售服务费                      | -                 | - | - | 407,565.34     | 407,565.34        |
| 应付交易费用                       | -                 | - | - | 343,066.22     | 343,066.22        |
| 应交税费                         | -                 | - | - | 613,391.50     | 613,391.50        |
| 应付利息                         | -                 | - | - | 385,862.69     | 385,862.69        |
| 其他负债                         | -                 | - | - | 179,000.00     | 179,000.00        |

|         |                   |   |   |                |                   |
|---------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 负债总计    | 3,544,736,248.49  | - | - | 11,082,730.56  | 3,555,818,979.05  |
| 利率敏感度缺口 | 41,631,410,257.74 | - | - | 178,858,197.64 | 41,810,268,455.38 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                                 |                     |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
| 假设 | 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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2022年12月31日              | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 市场利率上升25个基点        | -27,100,049.96                  | -14,293,800.04      |
|    | 市场利率下降25个基点        | 27,203,993.30                   | 14,344,877.40       |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 25,340,539,042.33  | 18,444,414,215.30   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 25,340,539,042.33  | 18,444,414,215.30   |

#### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期末及上年度末均未持有第三层次以公允价值计量的金融资产。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期末及上年度末均无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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            | 25,340,539,042.33 | 48.69        |
|    | 其中：债券             | 23,005,019,933.95 | 44.20        |
|    | 资产支持证券            | 2,335,519,108.38  | 4.49         |
| 2  | 买入返售金融资产          | 14,829,430,462.30 | 28.49        |
|    | 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      | 11,418,643,216.67 | 21.94        |
| 4  | 其他各项资产            | 457,224,468.00    | 0.88         |
| 5  | 合计                | 52,045,837,189.30 | 100.00       |

## 8.2 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 | 5.66             |              |
|    | 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 | 4,553,231,287.86 | 9.59         |
|    | 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%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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 | 89 |



|                   |    |
|-------------------|----|
| 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 | 61 |

### 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。

### 8.3.2 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                | 52.39              | 9.59               |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)—60天           | 3.03               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60天(含)—90天           | 10.39              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 4  | 90天(含)—120天          | 7.17               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 36.38              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
|    | 合计                   | 109.36             | 9.59               |

### 8.4 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。

### 8.5 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               | 189,344,733.41    | 0.40  |
| 2  | 央行票据               | -                 | -     |
| 3  | 金融债券               | 3,130,911,435.62  | 6.59  |
|    | 其中：政策性金融债          | 2,767,549,467.81  | 5.83  |
| 4  | 企业债券               | 10,178,902.97     | 0.02  |
| 5  | 企业短期融资券            | 70,744,893.61     | 0.15  |
| 6  | 中期票据               | 30,674,345.78     | 0.06  |
| 7  | 同业存单               | 19,573,165,622.56 | 41.23 |
| 8  | 其他                 | -                 | -     |
| 9  | 合计                 | 23,005,019,933.95 | 48.45 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                 | -     |

**8.6 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)    | 摊余成本                 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------------|------------|----------------------|--------------|
| 1  | 112211115 | 22平安银行C<br>D115 | 16,100,000 | 1,587,095,288.<br>57 | 3.34         |
| 2  | 200407    | 20农发07          | 14,100,000 | 1,437,254,099.<br>37 | 3.03         |
| 3  | 112212141 | 22北京银行C<br>D141 | 7,000,000  | 689,726,176.97       | 1.45         |
| 4  | 112215430 | 22民生银行C<br>D430 | 6,800,000  | 676,862,215.16       | 1.43         |
| 5  | 112220173 | 22广发银行C<br>D173 | 6,000,000  | 597,824,555.46       | 1.26         |
| 6  | 160207    | 16国开07          | 5,100,000  | 524,842,778.99       | 1.11         |
| 7  | 112283371 | 22东莞银行C<br>D191 | 5,000,000  | 499,443,241.24       | 1.05         |
| 8  | 112271350 | 22晋商银行C<br>D168 | 5,000,000  | 498,298,446.17       | 1.05         |
| 9  | 112211139 | 22平安银行C         | 5,000,000  | 497,129,347.70       | 1.05         |

|    |           |                 |           |                |      |
|----|-----------|-----------------|-----------|----------------|------|
|    |           | D139            |           |                |      |
| 10 | 112282116 | 22南京银行C<br>D114 | 5,000,000 | 494,516,197.80 | 1.04 |

### 8.7 “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                  | 0.0995%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.1254% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0537%  |

#### 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。

### 8.8 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  | 183287 | 明珠03优  | 2,000,000 | 204,089,336.98 | 0.43         |
| 2  | 183853 | 长兴09A2 | 1,550,000 | 157,315,700.00 | 0.33         |
| 3  | 180046 | 25欲晓A2 | 1,500,000 | 151,709,400.00 | 0.32         |
| 4  | 180037 | 25欲晓A1 | 1,500,000 | 151,544,400.00 | 0.32         |
| 5  | 180792 | 工鑫6A2  | 1,500,000 | 150,817,052.06 | 0.32         |
| 6  | 179821 | 至诚9A   | 980,000   | 100,177,543.89 | 0.21         |
| 7  | 183460 | 明珠02优  | 945,000   | 96,507,024.66  | 0.20         |
| 8  | 193286 | 至诚13A  | 930,000   | 93,604,780.27  | 0.20         |
| 9  | 135305 | 国链38A1 | 670,000   | 67,735,950.03  | 0.14         |
| 10 | 135146 | 瑞新34A1 | 660,000   | 66,957,575.01  | 0.14         |

### 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体中：

(1) 平安银行：2022/03/25银保监会根据银保监罚决字〔2022〕24号对平安银行罚款，违规事由为未依法履行职责。

(2) 民生银行：2022/03/25银保监会出具银保监罚决字〔2022〕20号，对违规提供担保及财务资助进行罚款。

(3) 广发银行：2022/03/25银保监会根据银保监罚决字〔2022〕23号对广发银行罚款，违规事由为违规经营。

(4) 东莞银行：2022/04/14东莞银保监分局根据东银保监罚决字〔2022〕8号对东莞银行罚款，违规事由为未依法履行职责。

该证券经信用研究员出具相关意见，并进行债券入库审批流程，基金管理人经过研究判断，按照相关投资决策流程投资了该债券。除此以外，本基金投资决策程序均符合相关法律法规的要求，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、处罚以致于影响投资决策流程的情形。

### 8.9.3 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 | 53,456.63      |
| 2  | 应收清算款 | 442,171,011.37 |
| 3  | 应收利息  | -              |
| 4  | 应收申购款 | 15,000,000.00  |
| 5  | 其他应收款 | -              |
| 6  | 待摊费用  | -              |
| 7  | 其他    | -              |
| 8  | 合计    | 457,224,468.00 |

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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      |
| 兴业安润货币A | 474      | 50,398.20          | 23,381,628.71         | 97.87<br>72% | 507,118.16 | 2.122<br>8% |
| 兴业安润货币B | 94       | 504,838,401.4<br>2 | 47,454,809,733.5<br>1 | 100.0<br>0%  | 0.00       | 0.00%       |
| 合计      | 568      | 83,589,257.89      | 47,478,191,362.2<br>2 | 99.99<br>89% | 507,118.16 | 0.001<br>1% |

注：1、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）。

2、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。

### 9.2 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  | 007-银行类机构 | 3,361,386,982.52 | 7.08%  |
| 2  | 007-银行类机构 | 3,317,205,152.00 | 6.99%  |
| 3  | 007-银行类机构 | 3,106,014,801.19 | 6.54%  |
| 4  | 007-银行类机构 | 3,094,053,256.36 | 6.52%  |
| 5  | 007-银行类机构 | 2,954,500,594.90 | 6.22%  |
| 6  | 007-银行类机构 | 2,508,411,298.44 | 5.28%  |
| 7  | 007-银行类机构 | 2,058,095,808.73 | 4.33%  |
| 8  | 007-银行类机构 | 2,015,168,090.94 | 4.24%  |
| 9  | 007-银行类机构 | 2,011,512,514.22 | 4.24%  |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 10 | 007-银行类机构 | 1,535,597,029.37 | 3.23% |
|----|-----------|------------------|-------|

### 9.3 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<br>(份) | 占基金总份额比<br>例 |
|------------------|---------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 兴业安润货币A | 15.02         | 0.0001%      |
|                  | 兴业安润货币B | -             | -            |
|                  | 合计      | 15.02         | 0.00%        |

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）。

### 9.4 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<br>间（万份） |
|--|---------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 兴业安润货币A | 0                     |
|  | 兴业安润货币B | 0                     |
|  | 合计      | 0                     |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 兴业安润货币A | 0                     |
|  | 兴业安润货币B | 0                     |
|  | 合计      | 0                     |

### §10 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            |
|--------------------------------|----------------|--------------------|
| 基金合同生效日(2017年01月06<br>日)基金份额总额 | 9,654.06       | 200,000,000.00     |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 38,402,368.74  | 41,771,866,086.64  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 149,591,479.70 | 135,601,313,718.04 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 164,105,101.57 | 129,918,370,071.17 |

|             |               |                   |
|-------------|---------------|-------------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 23,888,746.87 | 47,454,809,733.51 |
|-------------|---------------|-------------------|

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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、经上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自2022年11月7日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

### 11.3 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、本基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给会计师事务所的报酬为5万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为6年。

由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）继续执行 2022 年年度报告审计。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |    |
| 东方证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华福证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 浙商证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：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 资历雄厚，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，本期未新增及剔除券商交易单元。

### 11.7.2 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 |
| 东方证券 | 1,852,636,212.07 | 100.00%      | 1,553,115,878,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 方正证券 | -                | -            | -                    | -              | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券 | -                | -            | -                    | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华福证券 | -                | -            | -                    | -              | -    | -            | -    | -            |
| 浙商证券 | -                | -            | -                    | -              | -    | -            | -    | -            |

### 11.8 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。

### 11.9 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  | 兴业安润货币市场基金2021年第4季度报告              | 中国证监会规定的媒介 | 2022-01-24 |
| 4  | 兴业安润货币市场基金招募说明书更新                  | 中国证监会规定的媒介 | 2022-03-05 |
| 5  | 兴业安润货币市场基金2021年年度报告                | 中国证监会规定的媒介 | 2022-03-31 |
| 6  | 兴业安润货币市场基金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财富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唐鼎耀华基金销售有限公司业务合作的公告 | 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植信基金销售有限公司业务合作的公告   | 中国证监会规定的媒介 | 2022-05-28 |
| 10 | 兴业安润货币市场基金2022年第二季度报告               | 中国证监会规定的媒介 | 2022-07-21 |
| 11 | 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 | 2022-08-09 |
| 12 | 兴业安润货币市场基金基金产品资料概要更新                | 中国证监会规定的媒介 | 2022-08-19 |
| 13 | 兴业基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级评级的通知       | 中国证监会规定的媒介 | 2022-08-23 |
| 14 | 兴业安润货币市场基金2022年中期报告                 | 中国证监会规定的媒介 | 2022-08-31 |
| 15 | 兴业安润货币市场基金2022年第三季度报告               | 中国证监会规定的媒介 | 2022-10-26 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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免费查阅。

### 13.3 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  
二〇二三年三月三十一日