

兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018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:2018年07月19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规定,于2018年7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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况
2.1 基金基本情况

基金简称	兴业瑞丰6个月定期债券
基金代码	001411
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年03月23日
报告期内基金份额总额	2,999,999,940.2份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动投资管理,追求基金资产的长期增值。
投资策略	封闭期内,本基金在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济状况、国家货币政策和财政政策的跟踪分析,自上而下进行资产配置和品种选择,合理配置资产,风险水平,在有效控制风险的基础上,动态调整基金大类资产的投资比例,力争为基金资产获取长期收益。 开放期内,本基金在保持投资组合流动性、分散度的前提下,主要投资于信用等级较高的债券品种,追求流动性风险,力争获取超额收益。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

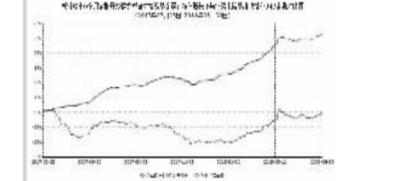
3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期 2018年04月01日 - 2018年06月30日
1.本期已实现收益	34,613,866.91
2.本期利润	38,992,934.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.01219
期末基金资产净值	3,130,019,933.46
期末基金份额净值	1.0433

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.基金净值表现
3.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率基准收益②	业绩比较基准收益率③	净值增长率与基准收益差④	①-②	②-③
过去三个月	1.23%	0.06%	1.01%	0.10%	0.22%	-0.04%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数收益率
3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金基金合同于2017年3月23日生效,根据本基金基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内已经基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

4 管理人报告
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 起止日期 离任日期	证券从业年限	说明
杨晓君	基金经理	2017-03-23	8年	中国籍,硕士学位,金融风险管理师(FRM),具有证券投资基金从业资格,2010年7月至2013年6月,任招商基金管理有限公司主要从事基金产品及证券研究分析工作,2013年6月至2014年5月任信达基金管理有限责任公司主要从事基金产品及证券研究分析工作,2014年5月加入兴业基金管理有限公司,现任固定收益部基金经理。
徐宗	固定收益部副经理兼投资总监、基金经理	2017-04-28	10年	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格,2008年7月至2012年5月,在兴业银行总行资产管理中心从事债券交易、债券销售,2012年5月至2013年9月,在法华银行总行资产管理部担任基金经理,2013年6月加入兴业基金管理有限公司,现任固定收益部副经理兼投资总监、基金经理。

1.对基金经理的任职条件,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别根据公司董事会确定的聘任日期和解聘日期;
2.证券从业的含义遵从行业协会(证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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,未发现损害基金份额持有人的行为。

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,债券市场震荡走低,央行降准与货币政策偏宽松呵护资金面,基本数据疲软,中债买券攀升,债券市场情绪较好,多数因素促使债券市场各期限利率普遍下行,市场情绪较为乐观。
本基金报告期内保持稳健的价值投资理念与稳健的票息策略,继续执行中等久期策略,在资产轻操作,在信用风险事件频发背景下,严控信用风险,精细持仓,保持组合主体信用评级,在资产到期后继续收益较高且资质良好的信用债品种,适当减持主体资质较弱的债券,为组合收益积累充足安全垫,积极把握债券市场上基的债券多寡口,匹配较长久期的活跃利率债品种,灵活捕捉适当高债仓位,拉长时间并提升组合弹性,在获取票息和较为有利的资本利得收益,净值呈现稳健上升趋势,报告期内收益排名位于市场上游。
下一阶段,本基金将继续审慎宏观研判,严控信用风险,把握市场节奏,谨防市场短期超预期风险,在基本面企稳下行与宽松去杠杆进程中,保持稳健策略操作,适当调整债券仓位与组合久期,稳健运行,继续为持有人谋求长期利益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内,基金份额净值增长率为1.23%,同期业绩比较基准收益率为1.01%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	固定收益投资	3,505,007,000.00	97.56
其中:债券	3,455,007,000.00	96.56	
资产支持证券	50,000,000.00	1.39	
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	9,523,847.92	0.27
8	其他资产	78,605,768.74	2.19
9	合计	3,565,136,616.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。
5.4 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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	743,204,000.00	23.74
其中:政策性金融债	272,662,000.00	8.71	
4	企业债券	1,397,433,000.00	44.65
5	企业短期融资券	792,835,000.00	25.33
6	中期票据	521,535,000.00	16.66
7	可转换(可交换)债	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,455,007,000.00	110.38

5.5 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180205	18国债05	2,600,000	272,662,000.00	8.71
2	1722027	17东风汽车债02	1,000,000	100,900,000.00	3.22
3	143992	18国债01	1,000,000	99,750,000.00	3.19
4	180447	18国债01	1,000,000	96,830,000.00	3.18
5	1780130	17广汇转债	1,000,000	96,930,000.00	3.16

5.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	116655	万利11A1	500,000	50,000,000.00	1.60

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资范围不包含股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资范围不包含股指期货。
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金投资范围不包含国债期货。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金投资范围不包含国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金投资范围不包含国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的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。
5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,955.66
2	应收证券清算款	10,374,400.00
3	应收股利	-
4	应收利息	68,211,413.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	78,605,768.74

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

报告期期初基金份额总额	2,999,999,940.21
报告期基金申购份额	0.01
减:报告期基金赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,999,999,940.21

注:总申购份额含红利再投资、转换入份额,总赎回份额含转换转出份额。
5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况
报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金明细
报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
5.8 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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的期间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180401-20180630	2,999,999,000.00	-	-	2,999,999,000.00	100.00%

注:报告期内持有基金份额比例达到或超过20%的情况,如涉及类举型资产管理,可能会对本基金流动性产生压力,该等风险将有可能导致:1)份额净值波动风险;2)基金净值波动风险;3)引发投资者对本基金的赎回潮而导致中小投资者无法及时赎回的风险;4)因基金资产净值低于5000万元从而触发赎回条款或触发基金合同终止等风险。管理人将在基金合同中明确约定的流动性水平,并对申购赎回进行合理的应对,加强流动性风险管理,保护持有人利益。
上述投资者比例为四舍五入,保留两位小数的结果。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。
9.9 基金文件目录
9.1 基金文件目录
(一)中国证监会准予兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金备案注册的文件
(二)《兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
(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
基金管理人、基金托管人的住所
9.3 查阅方式
投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。
网站: <http://www.cib-fund.com.cn>
投资者对本报告书如有疑问,可向本基金管理人兴业基金管理有限公司。
客户服务中心电话:400095561

2018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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月19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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

2 基金产品概况
2.1 基金基本情况

基金简称	兴业添利债券
基金代码	001299
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年06月10日
报告期内基金份额总额	9,993,464,533.60份
投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和判断,综合运用类属资产配置策略,久期策略,收益来源分散化,信用债投资策略,力求实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中国债券综合全价指数。
风险收益特征	本基金为债券基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

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

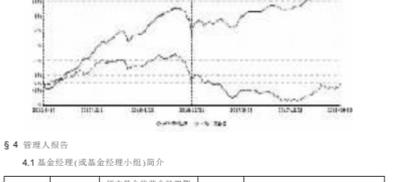
主要财务指标	报告期 2018年04月01日 - 2018年06月30日
1.本期已实现收益	69,227,636.28
2.本期利润	132,138,984.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.01312
期末基金资产净值	10,036,376,666.14
期末基金份额净值	1.004

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.基金净值表现(转型前)
3.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业添利债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数
3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长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 起止日期 离任日期	证券从业年限	说明
杨晓君	基金经理	2015-11-09	8年	中国籍,硕士学位,金融风险管理师(FRM),具有证券投资基金从业资格,2010年7月至2013年6月,任招商基金管理有限公司主要从事基金产品及证券研究分析工作,2013年6月至2014年5月任信达基金管理有限责任公司主要从事基金产品及证券研究分析工作,2014年5月加入兴业基金管理有限公司,现任固定收益部基金经理。

1.对基金经理的任职条件,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别根据公司董事会确定的聘任日期和解聘日期;
2.证券从业的含义遵从行业协会(证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明
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,未发现损害基金份额持有人的行为。

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,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,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 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,债券市场震荡走低,央行降准与货币政策偏宽松呵护资金面,基本数据疲软,中债买券攀升,债券市场情绪较好,多数因素促使债券市场各期限利率普遍下行,市场情绪较为乐观。
本基金报告期内保持稳健的价值投资理念与稳健的票息策略,继续执行中等久期策略,在资产轻操作,在信用风险事件频发背景下,严控信用风险,精细持仓,保持组合主体信用评级,在资产到期后继续收益较高且资质良好的信用债品种,适当减持主体资质较弱的债券,为组合收益积累充足安全垫,积极把握债券市场上基的债券多寡口,匹配较长久期的活跃利率债品种,灵活捕捉适当高债仓位,拉长时间并提升组合弹性,在获取票息和较为有利的资本利得收益,净值呈现稳健上升趋势,报告期内收益排名位于市场上游。
下一阶段,本基金将继续审慎宏观研判,严控信用风险,把握市场节奏,谨防市场短期超预期风险,在基本面企稳下行与宽松去杠杆进程中,保持稳健策略操作,适当调整债券仓位与组合久期,稳健运行,继续为持有人谋求长期利益。

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内,基金份额净值增长率为1.29%,同期业绩比较基准收益率为1.01%。
4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
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人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 投资组合报告
5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	固定收益投资	11,280,334,375.42	95.28
其中:债券	10,496,080,480.00	88.66	
资产支持证券	784,253,895.42	6.62	
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	买入返售金融资产	282,681,024.02	2.39
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	34,638,748.39	0.29
8	其他资产	240,971,585.52	2.04
9	合计	11,838,623,733.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票。
5.4 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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,654,430,000.00	16.48
其中:政策性金融债	1,305,175,000.00	13.00	
4	企业债券	5,708,939,500.00	56.88
5	企业短期融资券	793,960,000.00	7.91
6	中期票据	2,338,741,900.00	23.30
7	可转换(可交换)债	-	-
8	其他	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,496,080,480.00	104.56

5.5 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1808032	18国债03	3,950,000	401,478,000.00	4.00
2	170207	17国债07	3,500,000	350,000,000.00	3.49
3	180204	18国债04	3,400,000	348,534,000.00	3.47
4	101800703	18国债01	2,000,000	200,740,000.00	2.00
5	1622025	16国债05	2,000,000	200,540,000.00	2.00

5.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	061608001	16广和利2A	4,000,000	248,320,000.00	2.47
2	1789236	17广和利1A1	2,000,000	200,560,000.00	2.00
3	116643	广和利1A1	1,500,000	148,724,120.55	1.48
4	116605	广和利10A	500,000	50,000,000.00	0.50
5	1789265	17广和利3A	2,000,000	46,960,000.00	0.47
6	1789268	17广和利1B	420,000	42,050,400.00	0.42
7	142592	PR05 SA	1,120,000	38,292,598.16	0.38
8	142151	PR05 4A	300,000	9,376,757.71	0.09

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资范围不包含股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资范围不包含股指期货。
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金投资范围不包含国债期货。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金投资范围不包含国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金投资范围不包含国债期货。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的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。
5.11.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	39,940.00
2	应收证券清算款	33,325,024.11
3	应收股利	-
4	应收利息	207,606,626.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	240,971,585.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。
5.6 开放式基金份额变动
单位:份

报告期期初基金份额总额	9,993,464,533.60
报告期基金申购份额	1,680.05
减:报告期基金赎回份额	1,680.05
报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	9,993,464,533.60

注:总申购份额含红利再投资、转换入份额,总赎回份额含转换转出份额。
7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金基金份额变动情况
报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金明细
报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
5.8 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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的期间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180401-20180630	9,993,440,995.27	0.00	0.00	9,993,440,995.27	100.00%

注:报告期内持有基金份额比例达到或超过20%的情况,如涉及类举型资产管理,可能会对本基金流动性产生压力,该等风险将有可能导致:1)份额净值波动风险;2)基金净值波动风险;3)引发投资者对本基金的赎回潮而导致中小投资者无法及时赎回的风险;4)因基金资产净值低于5000万元从而触发赎回条款或触发基金合同终止等风险。管理人将在基金合同中明确约定的流动性水平,并对申购赎回进行合理的应对,加强流动性风险管理,保护持有人利益。
上述投资者比例为四舍五入,保留两位小数的结果。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。
9.9 基金文件目录
9.1 基金文件目录
(一)中国证监会准予兴业添利债券型证券投资基金备案注册的文件
(二)《兴业添利债券型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业添利债券型证券投资基金托管协议》
(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