兴业添利债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019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2019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。
本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业添利债券
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	8,393,502,380.70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,力争获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预测,综合运用类属资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、信用债投资策略等,力求规避风险并实现基金资产的保值增值。
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	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、预期收益的基金品种,其预期风险及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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	82,438,391.20
2.本期利润	80,423,593.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0096
4.期末基金资产净值	8,457,546,431.16
5.期末基金份额净值	1.008

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	0.99%	0.06%	-0.24%	0.06%	1.23%	0.00%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数。
3.2.2 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨逸君	基金经理	2015-11-9	-	9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,在海富通基金管理有限公司主要从事基金产品及证券市场研究分析工作;2013年6月至2014年5月在建信基金管理有限公司主要从事基金产品及量化投资相关的研究分析工作;2014年5月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内,本基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业添利债券基金份额净值为1.008元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.99%,同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,109,731,628.95	98.09
	其中:债券	8,875,636,702.60	95.57
	资产支持证券	234,094,926.35	2.52
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
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	12,354,946.41	0.13
8	其他资产	164,885,805.81	1.76
9	合计	9,286,972,381.17	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,748,991,000.00	20.68
	其中:政策性金融债	777,996,000.00	9.20
4	企业债券	4,036,007,702.60	47.72
5	企业短期融资券	892,665,000.00	10.55
6	中期票据	2,197,973,000.00	25.99
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,875,636,702.60	104.94

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	1828019	18平安银行01	4,000,000	403,760,000.00	4.77
2	170407	17农发07	3,500,000	353,220,000.00	4.18
3	180204	18国开04	2,000,000	208,980,000.00	2.47
4	1622025	16中银消费债	2,000,000	202,460,000.00	2.39
5	136837	16穗发01	2,000,000	199,920,000.00	2.36

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

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招行公积金2A	4,000,000	222,000,000.00	2.62
2	142392	PR远东5A	1,120,000	9,760,205.38	0.12
3	142151	PR远东4A	300,000	2,334,720.97	0.03

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
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
本基金本报告期末未持有国债期货。
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	2,369.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	164,883,436.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	164,885,805.81

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	8,393,500,907.74
报告期间基金总申购份额	9,718.17
减:报告期期间基金总赎回份额	8,245.21
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	8,393,502,380.70

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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份额变动情况
本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交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	8,393,440,595.27	-	-	8,393,440,595.27	100.00%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回,可能会对本基金造成流动性压力;同时,该等集中赎回将可能产生(1)份额净值尾差风险;(2)基金净值波动的风险;(3)因引发基金本身的巨额赎回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5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平,并对申购赎回进行合理的应对,加强防范流动性风险,保护持有人利益。							

上述份额占比为四舍五入,保留两位小数后的结果。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(一)中国证监会准予兴业添利债券型证券投资基金募集注册的文件
(二)《兴业添利债券型证券投资基金合同》
(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
(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
2019年07月19日

兴业短债债券型证券投资基金

(原兴业聚盛灵活配置证券投资基金转型)

2019年第二季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年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。
基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019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。
原兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金报告期自2019年4月1日起至5月20日止,兴业短债债券型证券投资基金报告期自2019年5月21日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

转型后

基金简称	兴业短债债券	
基金主代码	002301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年06月21日	
报告期末基金份额总额	111,393,777.68份	
投资目标	本基金主要通过重点投资短期债券,在严格控制风险和保持较高流动性的基础上,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上,结合定性分析和定量分析的方法,拟或对各大类资产的预期和判断,在基金合同约定的范围内确定债券资产和现金类资产的配置比例,并根据市场运行状况以及各类资产预期表现的相对变化,动态调整大类资产的配置比例,有效控制基金资产运作风险,提高基金资产风险调整后收益。	
业绩比较基准	中债-综合全价(1年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业短债债券A	兴业短债债券C
下属分级基金的交易代码	002301	002769
报告期末下属分级基金的份额总额	110,814,105.26份	579,672.39份

转型前

基金简称	兴业聚盛灵活配置混合	
基金主代码	002301	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年02月03日	
报告期末基金份额总额	101,915,554.23份	
投资目标	通过前瞻性地把握不同时期股票市场、债券市场、银行间市场的收益率,灵活运用资产配置等策略,在控制下行风险的前提下追求基金资产长期稳定增值。	
投资策略	本基金坚持获取稳健收益、长期价值的投资理念,动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化,追求基金资产的长期持续稳定增长。	
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+1%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中等风险品种。	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业聚盛灵活配置混合A	兴业聚盛灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	002301	002769
报告期末下属分级基金的份额总额	101,730,523.40份	185,030.83份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年05月21日 - 2019年06月30日)	
	兴业短债债券A	兴业短债债券C
1.本期已实现收益	1,622,517.09	6,478.75
2.本期利润	381,187.37	1,424.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0038
4.期末基金资产净值	123,577,495.14	625,509.99
5.期末基金份额净值	1.115	1.079

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。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日 - 2019年06月20日)	
	兴业聚盛灵活配置混合A	兴业聚盛灵活配置混合C
1.本期已实现收益	776,860.37	1,508.33
2.本期利润	474,834.22	541.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0047	0.0024
4.期末基金资产净值	113,077,335.60	199,088.00
5.期末基金份额净值	1.1120	1.0760

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。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 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

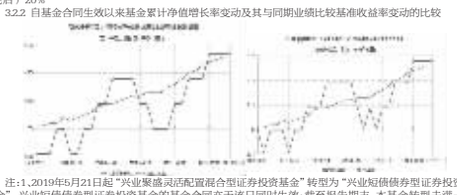
兴业短债债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.27%	0.06%	0.26%	0.01%	0.01%	0.05%

兴业短债债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.28%	0.06%	0.26%	0.01%	0.02%	0.05%

注:1、2019年5月21日起"兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业短债债券型证券投资基金",兴业短债债券型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效;
2、本基金转型前的业绩比较基准为:三年期银行人民币定期存款税后收益率+1%。
3、本基金转型后的业绩比较基准为:中债-综合全价(1年以下)指数收益率*80%+一年期定存利率(税后)*20%
3.2.2 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:1、2019年5月21日起"兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业短债债券型证券投资基金",兴业短债债券型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效;截至报告期末,本基金转型未满一年。
2、本基金转型后的业绩比较基准为:中债-综合全价(1年以下)指数收益率*80%+一年期定存利率(税后)*20%
3、本基金的投资转型期为自本基金转型日起的6个月。截至本报告期末,本基金尚在投资转型期。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 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

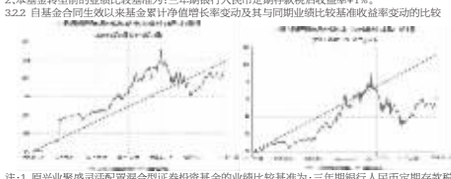
兴业聚盛灵活配置混合A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.45%	0.09%	0.51%	0.01%	-0.06%	0.08%

兴业聚盛灵活配置混合C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.37%	0.09%	0.51%	0.01%	-0.14%	0.08%

注:1、2019年5月21日起"兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业短债债券型证券投资基金",兴业短债债券型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效;
2、本基金转型前的业绩比较基准为:三年期银行人民币定期存款税后收益率+1%。
3.2.2 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:1、原兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准为:三年期银行人民币定期存款税后收益率+1%;
2、2019年5月21日起"兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金"转型为"兴业短债债券型证券投资基金",兴业短债债券型证券投资基金的基金合同亦于该日同时生效。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐青	基金经理	2017-5-9	2019-5-28	8年	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2011年7月至2014年1月,在华泰证券股份有限公司研究所担任债券研究员,从事债券研究工作;2014年2月至2016年8月,在国联安基金管理有限公司债券组合管理部从事债券投资研究工作,期间担任债券研究员和基金经理助理,其中2015年5月至2016年4月担任国联安德融增利证券投资基金的基金经理助理,2015年5月至2015年12月担任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金的基金经理助理,2016年3月至2016年8月担任国联安安稳保本混合型证券投资基金的基金经理助理。2016年9月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。
丁进	基金经理	2019-5-28	-	9年	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2005年7月至2008年2月,在北京顺泽锋投资咨询有限公司担任研究员;2008年2月至2010年10月,在新华信国际信息咨询(北京)有限公司担任金融研究高级咨询顾问;2010年10月至2012年8月,在光大证券研究所担任信用及转债研究员;2012年8月至2015年2月就职于浦银安盛基金管理有限公司,其中2012年8月至2015年2月担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金的基金经理助理,2012年9月至2015年2月担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,2013年5月至2015年2月担任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,2013年6月至2015年2月担任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2015年2月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。
刘禹含	基金经理	2019-5-28	-	6年	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2013年7月至2015年10月在万家基金管理有限公司担任债券交易员,主要从事债券交易工作。2015年11月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。

1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内,本基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

截至2019年5月20日,兴业聚盛灵活配置混合A基金份额净值为1.1120元;自2019年4月1日至2019年5月20日本基金份额净值增长率为0.45%,同期业绩比较基准收益率为0.51%。
截至2019年5月20日,兴业聚盛灵活配置混合C基金份额净值为1.0760元;自2019年4月1日至2019年5月20日本基金份额净值增长率为0.37%,同期业绩比较基准收益率为0.51%。
截至2019年6月30日,兴业短债债券A基金份额净值为1.115元;自2019年5月21日至2019年6月30日本基金份额净值增长率为0.27%,同期业绩比较基准收益率为0.26%。
截至2019年6月30日,兴业短债债券C基金份额净值为1.079元;自2019年5月21日至2019年6月30日本基金份额净值增长率为0.28%,同期业绩比较基准收益率为0.26%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告(转型后)

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,456,700.00	73.97
	其中:债券	99,456,700.00	73.97
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
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	33,156,731.99	24.66
8	其他资产	1,837,121.34	1.37
9	合计	134,450,553.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。
5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
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	国家债券	15,987,200.00	12.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	52,186,500.00	42.02
5	企业短期融资券	5,024,500.00	4.05
6	中期票据	26,258,500.00	21.14
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,456,700.00	80.08

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019611	19国债01	160,000	15,987,200.00	12.87
2	101800349	18张家公资MTN001	100,000	10,569,000.00	8.51
3	101800361	18太仓资产MTN001	100,000	10,434,000.00	8.40
4	1780130	17国旅投债	100,000	10,321,000.00	8.31
5	1780124	17诸暨国资债01	100,000	10,256,000.00	8.26

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
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
本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。
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	30,686.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,254,235.50
5	应收申购款	21,705.05
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,306,627.30

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	192,747,373.10
报告期期间基金总申购份额	72,294.136.27
减:报告期期间基金总赎回份额	100,519,431.50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	164,522,077.87

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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份额变动情况
本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交易明细
本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。
8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(一)中国证监会准予兴业机遇债券型证券投资基金募集注册的文件
(二)《兴业机遇债券型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业机遇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
2019年07月19日

兴业机遇债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年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。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019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。
本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业机遇债券
基金主代码	006717
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月13日
报告期末基金份额总额	164,522,077.87份
投资目标	在追求基金资产长期稳健收益的基础上,力争获取高于业绩基准的收益。
投资策略	本基金将由投资研究团队及时跟踪市场环境变化,根据对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,结合流动性、估值水平、风险偏好等因素,综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上,通过"自上而下"的资产配置及动态调整策略,将基金资产在股票、可转债、普通债券和现金等资产间进行配置并动态调整比例。并综合运用固定收益类证券投资策略、股票投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率*80%+中证可转债指数收益率*10%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金,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	招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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	515,033.45
2.本期利润	-6,412,328.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0346
4.期末基金资产净值	172,052,279.30
5.期末基金份额净值	1.0458

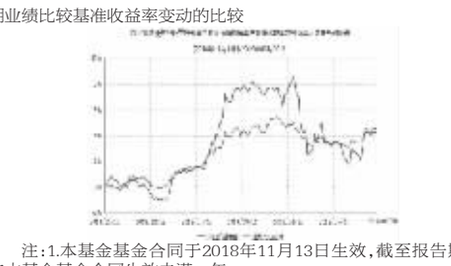
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-2.96%	0.56%	-0.59%	0.21%	-2.27%	0.35%

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×80%+中证可转债指数收益率×10%+沪深300指数收益率×10%
3.2.2 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:1.本基金基金合同于2018年11月13日生效,截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。
2、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使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 任职日期 |