兴业添天盈货币市场基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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2015年7月23日(基金成立日)起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业添天盈货币	
交易代码	001624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月23日	
报告期末基金份额总额	1,500,873,994.38份	
投资目标	在保持基金资产的安全性和流动性的前提下,通过主动式管理,力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量方法,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定当期收益。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
下属分级基金的交易代码	001624	001625
报告期末下属分级基金的份额总额	21,518.10份	1,500,852,476.28份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月23日 - 2015年9月30日)	
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
1. 本期已实现收益	31.77	927,353.30
2. 本期利润	31.77	927,353.30
3. 期末基金资产净值	21,518.10	1,500,852,476.28

注:1、本基金基金合同于2015年7月23日生效,本报告期自2015年7月23日起至2015年9月30日。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

兴业添天盈货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.1484%	0.0016%	0.2589%	0.0000%	-0.1105%	0.0016%

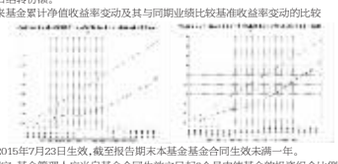
注:本基金收益分配为按日结转份额。

兴业添天盈货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.1953%	0.0016%	0.2589%	0.0000%	-0.0636%	0.0016%

注:本基金收益分配为按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2015年7月23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,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐莹	本基金基金经理、套利与量化投资部综合套利总监	2015年7月23日	-	7	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资,2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司。2014年3月13日至2015年7月24日担任兴业定开债券基金基金经理,2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2015年6月10日起担兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理。2015年7月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金基金经理,2015年7月23日起担任兴业添天盈货币市场基金基金经理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度,经济增长仍然偏弱,在持续宽松货币政策的影响下,房地产市场已经企稳,但开发商对房地产长期因素的担忧以及三四线城市库存压力的影响,房地产开工和投资需求仍然较为低迷。同时,第三季度全球风险因素开始凸显,美国加息的干扰和新兴市场国家汇率的贬值对投资者的风险偏好形成较大的负面影响。融资需求的低迷和风险偏好的下降是驱动第三季度债券市场收益率下行的主要因素。

报告期内,为确保组合流动性,维持基金回购、存款等货币市场工具的配置比例,同时增持资质优良的短期融资券比例及资产支持证券,力争在保证流动性的前提下提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类份额净值增长率为0.1484%,同期业绩比较基准收益率为0.2589%,本基金B类份额净值增长率为0.1953%,同期业绩比较基准收益率为0.2589%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度,经济依然面临下行压力,CPI涨幅可能放缓,工业品通缩局面持续,而政策托底效应可能开始体现。政策角度,预计仍将维持宽松的货币政策,可能存在降准和降息的机会。整体资金面上,R007中枢将持续低位运行,预计年末因素将对资金面产生明显扰动。基于此,四季度本基金将加大银行存款投资力度,增持部分金融债券和短期融资券,并适当拉长投资期限,提高投资收益。关注年末流动性变化和政策调整,保持组合良好的流动性,做到流动性、安全性和收益性的有机统一,为基金持有人提供稳定的收益回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	551,284,500.78	36.72
	其中:债券	355,719,483.08	23.70
	资产支持证券	195,565,017.70	13.03
2	买入返售金融资产	840,000,000.00	55.96
	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	108,228,111.68	7.21
4	其他资产	1,668,609.62	0.11
5	合计	1,501,181,222.08	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.00	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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

注: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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注: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180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	63.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	6.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	8.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	21.92	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.91	-

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	摊余成本(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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	355,719,483.08	23.70
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	355,719,483.08	23.70
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011525005	15中化股SCP005	1,000,000	100,004,684.79	6.66
2	011599560	15申能股SCP001	1,000,000	99,822,641.14	6.65
3	011585004	15北控集SCP004	860,000	85,945,607.59	5.73
4	011574006	15陕煤化SCP006	500,000	49,954,766.49	3.33
5	011584006	15宁沪高SCP006	100,000	10,001,591.89	0.67
6	041554056	15厦国港CP001	100,000	9,990,191.18	0.67

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0151%
报告期内偏离度的最低值	-0.0007%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0013%

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	1589078	15京元1A1	900,000	90,073,715.35	6.00
2	1589092	15招元2A2	1,000,000	73,351,295.04	4.89
3	1589085	15德宝天元1A1	1,129,000	32,140,007.31	2.14

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

5.8.2

本报告期内本基金不存在剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,668,609.62
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,668,609.62

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
基金合同生效日(2015年7月23日)基金份额总额	21,402.26	200,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	118.84	1,300,852,476.28
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3.00	-
报告期期末基金份额总额	21,518.10	1,500,852,476.28

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予兴业添天盈货币市场基金募集注册的文件

2.《兴业添天盈货币市场基金基金合同》

3.《兴业添天盈货币市场基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

8.3 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
2015年10月24日

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业稳固收益两年理财债券
交易代码	001369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月10日
报告期末基金份额总额	1,848,424,447.64份
投资目标	本基金采取严格的买入持有到期投资策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求为投资者获取稳健的收益。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内,本基金采用买入并持有策略构建投资组合,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下,本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构两年期定期存款利率(税后)。
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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	13,670,246.19
2.本期利润	13,670,246.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.0074
4.期末基金资产净值	1,864,180,511.90
5.期末基金份额净值	1.009

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。

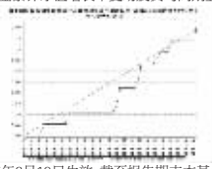
3、本基金于2015年6月10日成立。

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	0.80%	0.03%	0.72%	0.01%	0.08%	0.02%

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2015年6月10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,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐莹	本基金的基金经理、套利与量化投资部综合套利总监	2015年6月10日	-	7	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资,2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司。2014年3月13日至2015年7月24日担任兴业定开债券基金基金经理,2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2015年6月10日起兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理。2015年7月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金基金经理,2015年7月23日起担任兴业添天盈货币市场基金基金经理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度,经济增长仍然偏弱,在持续宽松货币政策的影响下,房地产市场已经企稳,但开发商对房地产长期因素的担忧以及三四线城市库存压力的影响,房地产开工和投资需求仍然较为低迷。同时,第三季度全球风险因素开始凸显,美国加息的干扰和新兴市场国家汇率的贬值对投资者的风险偏好形成较大的负面影响。融资需求的低迷和风险偏好的下降是驱动第三季度债券市场收益率下行的主要因素。

报告期内,基于债券绝对收益率水平、各类利差状况、资金面以及债券供需等多方面综合考虑,同时结合本基金的持有配置策略,维持组合短久期的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为0.80%,同期业绩比较基准收益率为0.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期来看,随着经济潜在增速的下降,债券市场收益率长期下行的趋势没有改变,低利率和低资本回报率正在成为一种常态。第四季度受房地产市场回暖的影响,预计投资需求有可能出现短期的企稳,但幅度较为有限,货币政策保持相对宽松。目前债券市场收益率水平和信用利差均处于低位,利差反映了股市资金回流导致的流动性宽松,但也压缩了信用风险补偿的空间。我们对第四季度债券市场的展望相对保守,也会采取较为稳健的操作策略。我们将密切跟踪经济、政策、环境的变化,及时调整组合的久期和信用结构,严格把握债券的信用风险,适当降低风险偏好,继续在风险可控的原则下为投资者争取更好的投资回报。

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	1,801,881,520.04	96.59
	其中:债券	1,437,892,580.30	77.08
	资产支持证券	363,988,939.74	19.51
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	35,703,879.57	1.91
8	其他资产	27,820,522.72	1.49
9	合计	1,865,405,922.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	515,275,080.84	27.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	922,617,499.46	49.49
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,437,892,580.30	77.13

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	1182218	11伊泰MTN1	1,700,000	174,412,888.85	9.36
2	0980147	09中航工侦浮	1,700,000	173,162,063.87	9.29
3	1182227	11开深股MTN1	1,400,000	143,692,250.73	7.71
4	0980132	09国网债01	1,200,000	122,612,892.33	6.58
5	1182225	11新汶矿MTN1	1,000,000	102,725,583.86	5.51

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	1589079	15京元1A2	1,400,000	121,370,513.92	6.51
2	1589067	15兴银2A2	1,410,000	106,221,743.92	5.70
3	1589086	15德宝天元1A2	350,000	34,669,000.35	1.86
4	1589080	15京元1B	320,000	31,939,113.07	1.71
5	1589076	15威元1B	303,000	30,225,657.49	1.62
6	1589087	15德宝天元1B	204,000	20,143,490.92	1.08
7	1589063	15兴银1A2	300,000	19,419,420.07	1.04

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

注: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

注: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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,820,522.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,820,522.72

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,848,424,447.64
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,848,424,447.64

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金募集注册的文件

2.《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金基金合同》

3.《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件和营业执照

6.基金托管人业务资格批件和营业执照

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人住所

8.3 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
2015年10月24日

兴业稳固收益一年理财债券型证券投资金

【2015】第三季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业稳固收益一年理财债券
交易代码	001368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月10日
报告期末基金份额总额	1,245,126,262.46份
投资目标	本基金采取严格的买入持有到期投资策略,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求为投资者获取稳健的收益。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内,本基金采用买入并持有策略构建投资组合,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配,投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。一般情况下,本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构一年期定期存款利率(税后)。
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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	5,305,291.72
2.本期利润	5,305,291.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0043
4.期末基金资产净值	1,252,049,972.03
5.期末基金份额净值	1.006

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。

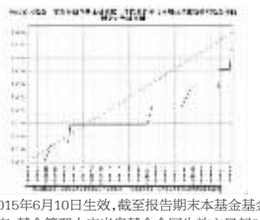
3、本基金于2015年6月10日成立。

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	0.50%	0.03%	0.57%	0.01%	-0.07%	0.02%

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2015年6月10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,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐莹	本基金的基金经理、套利与量化投资部综合套利总监	2015年6月10日	-	7	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资,2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司。2014年3月13日至2015年7月24日担任兴业定开债券基金基金经理,2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2015年6月10日起兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理。2015年7月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金基金经理,2015年7月23日起担任兴业添天盈货币市场基金基金经理。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第三季度,经济增长仍然偏弱,在持续宽松货币政策的影响下,房地产市场已经企稳,但开发商对房地产长期因素的担忧以及三四线城市库存压力的影响,房地产开工和投资需求仍然较为低迷。同时,第三季度全球风险因素开始凸显,美国加息的干扰和新兴市场国家汇率的贬值对投资者的风险偏好形成较大的负面影响。融资需求的低迷和风险偏好的下降是驱动第三季度债券市场收益率下行的主要因素。

报告期内,基于债券绝对收益率水平、各类利差状况、资金面以及债券供需等多方面综合考虑,同时结合本基金的持有配置策略,维持组合短久期的策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为0.5%,同期业绩比较基准收益率为0.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期来看,随着经济潜在增速的下降,债券市场收益