兴业添利债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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2017年1月1日起至3月31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6月10日
报告期末基金份额总额	9,993,613,971.01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(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	97,872,105.63
2.本期利润	45,536,517.52
3.加权平均基金份额本期利润	0.0046
4.期末基金资产净值	10,057,513,775.89
5.期末基金份额净值	1.006

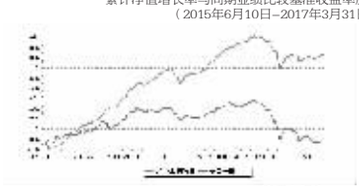
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	0.40%	0.07%	-1.24%	0.07%	1.64%	-

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

兴业添利债券型证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月10日-2017年3月31日)



§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		
杨逸君	本基金的基金经理	2015年11月9日	-	6	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。
徐莹	本基金的基金经理	2015年7月6日	-	8	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,在兴业银行总行资金营运中心从事债券交易,债券投资;2012年5月至2013年6月,在兴业银行总行资产管理部从事组合投资管理;2013年6月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。

注: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
报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内,国内基本面表现平稳,国内宏观经济环境处于弱复苏状态,房地产和制造业投资略有回落,受房地产调控和房贷收紧影响,三四线城市销量明显下降。通胀方面,国内通胀压力减轻,PPI向CPI传导结果显著低于预期,年内 CPI中枢预计在1.6%~1.9%,随着低基数时期的跨越,未来PPI同比或逐步回落。外部环境方面,美国经济持续复苏,美联储预计将加快加息进程,年内缩表预期升温;美国居民消费驱动本轮经济上行,工业企业进入主动补库存周期,就业状况不断改善。国内政策面来看,依旧保持稳健中性货币政策,受美联储加息和金融去杠杆影响,一季度央行上调货币政策工具利率,预计货币环境将继续维持中性偏紧的局面,目前国际收支保持稳定,货币政策重心在于防控金融风险。在此大背景下,债市受政策波动影响较大,春节前后上调公开市场利率后收益率一度上行,而后保持高位振荡,美联储加息靴子落地利空出尽后,债市小幅回暖,季末时点,资金面受MPA考核影响,流动性趋紧,资金利率走高,债市方面整体受季末时点影响较温和。下阶段需继续观望美联储加息进程、央行货币政策态度以及金融去杠杆的实施效果,留意资金面和市场情绪波动。
报告期内,本组合维持较低的信用债配置比例,谨慎进行杠杆操作,适当增加了同业存单的配置比例,并在春节、季末等关键时点进行逆回购操作,力争在保证流动性的前提下提高组合收益。
下一阶段,我们将持续关注国内经济基本面情况,密切关注央行货币政策及监管动向,在警惕流动性以及信用风险的大前提下,采取较为稳健的操作策略,谨慎杠杆操作,久期跟随市场节奏。

4.5 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0.40%,同期业绩比较基准收益率为-1.24%。

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	9,247,003,720.00	91.87
	其中:债券	7,733,646,220.00	76.84
	资产支持证券	1,513,357,500.00	15.04
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	571,203,935.12	5.68
	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	22,082,216.69	0.22
8	其他资产	224,709,571.45	2.23
9	合计	10,064,999,443.26	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	539,932,000.00	5.37
	其中:政策性金融债	539,932,000.00	5.37
4	企业债券	6,451,442,820.00	64.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	562,497,900.00	5.59
7	可转债	-	-
8	同业存单	179,773,500.00	1.79
9	其他	-	-
10	合计	7,733,646,220.00	76.89

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	101652016	16大连万达MTN001	2,200,000	210,496,000.00	2.09
2	160308	16进出08	2,000,000	199,440,000.00	1.98
3	1480337	14龙泉国投债	1,670,000	175,266,500.00	1.74
4	1580078	15株今添债	1,600,000	165,072,000.00	1.64
5	1480200	14郴州国资债	1,500,000	158,565,000.00	1.58

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沪公积金2A	4,000,000	296,000,000.00	2.94
2	061605001	16沪公积金1A	4,000,000	274,600,000.00	2.73
3	1689053	16建元1A3	2,000,000	189,380,000.00	1.88
4	1689156	16福元2A	2,500,000	147,350,000.00	1.47
5	1689139	16华银4A	2,600,000	123,006,000.00	1.22
6	1689087	16永生1A2	1,210,000	116,305,200.00	1.16
7	1689150	16睿程2A2	1,300,000	85,995,000.00	0.86
8	1589168	15金富2A2	3,120,000	57,158,400.00	0.57
9	1689175	16恒金2A2	1,500,000	54,255,000.00	0.54
10	1689207	16永生2A2	520,000	51,225,200.00	0.51

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	7,513.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	224,702,068.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,709,571.45

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	9,993,716,189.83
报告期期间基金总申购份额	393.41
减:报告期期间基金总赎回份额	102,612.23
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	9,993,613,971.01

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	20170101-20170331	9993440595.27	0	0	9993440595.27	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。

§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
二〇一七年四月二十一日

兴业添天盈货币市场基金

【2017】第一季度报告

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:2017年04月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业添天盈货币	
基金主代码	001624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月23日	
报告期末基金份额总额	10,409,260,284.06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	26,377.88份	10,409,233,906.18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(2017年01月01日-2017年03月31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	192.50	100,945,171.13
2.本期利润	192.50	100,945,171.13
3.期末基金资产净值	26,377.88	10,409,233,906.18

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
1、兴业添天盈货币A

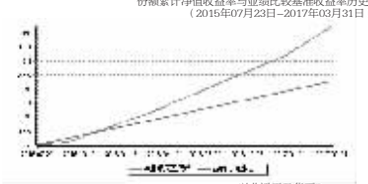
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9214%	0.0016%	0.3329%	0.0000%	0.5885%	0.0016%

注:1、本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。
2、本基金收益分配为按日结转份额。
2、兴业添天盈货币B

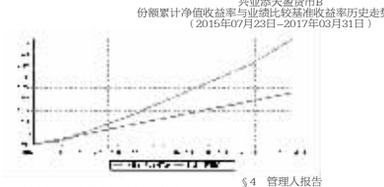
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9792%	0.0016%	0.3329%	0.0000%	0.6463%	0.0016%

注:1、本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。
2、本基金收益分配为按日结转份额。
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴业添天盈货币A
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月23日-2017年03月31日)



兴业添天盈货币B
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月23日-2017年03月31日)



§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	2015年07月23日	-	8	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,在兴业银行总行资金营运中心从事债券交易,债券投资;2012年5月至2013年6月,在兴业银行总行资产管理部从事组合投资管理;2013年6月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。
杨逸君	本基金的基金经理	2015年11月09日	-	6	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。

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

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的基金和投资组合。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内,国内基本面表现平稳,国内宏观经济环境处于弱复苏状态,房地产和制造业投资略有回落,受房地产调控和房贷收紧影响,三四线城市销量明显下降。通胀方面,国内通胀压力减轻,PPI向CPI传导结果显著低于预期,年内 CPI中枢预计在1.6%~1.9%,随着低基数时期的跨越,未来PPI同比或逐步回落。外部环境方面,美国经济持续复苏,美联储预计将加快加息进程,年内缩表预期升温;美国居民消费驱动本轮经济上行,工业企业进入主动补库存周期,就业状况不断改善。国内政策面来看,依旧保持稳健中性货币政策,受美联储加息和金融去杠杆影响,一季度央行上调货币政策工具利率,预计货币环境将继续维持中性偏紧的局面,目前国际收支保持稳定,货币政策重心在于防控金融风险。在此大背景下,债市受政策波动影响较大,春节前后上调公开市场利率后收益率一度上行,而后保持高位振荡,美联储加息靴子落地利空出尽后,债市小幅回暖,季末时点,资金面受MPA考核影响,流动性趋紧,资金利率走高,债市方面整体受季末时点影响较温和。下阶段需继续观望美联储加息进程、央行货币政策态度以及金融去杠杆的实施效果,留意资金面和市场情绪波动。
报告期内,本组合维持较低的信用债配置比例,谨慎进行杠杆操作,适当增加了同业存单的配置比例,并在春节、季末等关键时点进行逆回购操作,力争在保证流动性的前提下提高组合收益。
下一阶段,我们将持续关注国内经济基本面情况,密切关注央行货币政策及监管动向,在警惕流动性以及信用风险的大前提下,采取较为稳健的操作策略,谨慎杠杆操作,保持短久期策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现
报告期内,本基金A类份额净值收益率为0.9214%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%,本基金B类份额净值收益率为0.9792%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	9,687,241,728.25	91.72
	其中:债券	9,667,876,616.19	91.54
	资产支持证券	19,365,112.06	0.18
2	买入返售金融资产	432,075,808.12	4.09
	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	405,021,119.98	3.83
4	其他资产	37,430,951.37	0.35
5	合计	10,561,769,607.72	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	0.38
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	147,899,538.15	1.42
	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%。

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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	92

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	12.46	1.42
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	13.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	29.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	22.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.10	1.42

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明
在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	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	1,040,071,760.16	9.99
	其中:政策性金融债	1,040,071,760.16	9.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,755,798,828.40	16.87
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,872,006,027.63	66.02
8	其他	-	-
9	合计	9,667,876,616.19	92.88
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111609508	16浦发CD608	8,000,000	791,675,352.24	7.61
10	111617319	16光大CD319	2,800,000	277,105,564.44	2.66
2	111617321	16光大CD321	5,500,000	544,319,128.16	5.23
3	111613109	16浙商CD109	5,000,000	492,566,975.60	4.73
4	111716004	17上海银行CD004	4,000,000	395,286,285.11	3.80
5	011698725	16国电SCP006	3,500,000	347,212,291.15	3.34
6	011697031	16南电SCP002	3,500,000	346,374,477.99	3.33
7	011698630	16华夏CD180	3,000,000	299,856,478.37	2.88
8	111618180	16东航股SCP014	3,000,000	298,111,765.45	2.86
9	111790462	17杭州银行CD012	3,000,000	296,200,895.95	2.85

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.2474%
报告期内偏离度的最低值	0.0009%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1226%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1589208	15京城1A2	1,400,000	19,376,000.00	0.19

5.9 投资组合报告附注
5.9.1 基金计价方法说明。
本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。
本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。
5.9.2 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。
5.9.3 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	应收利息	37,430,951.37
4	应收申购款	
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	37,430,951.37

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
报告期期初基金份额总额	20,890.07	10,308,247,924.81
报告期期间基金总申购份额	5,592.03	100,985,981.37
报告期期间基金总赎回份额	104.22	-
报告期期末基金份额总额	26,377.88	10,409,233,906.18

注:申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额;赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	20170101-20170331	10307112843.36	102121062.82	0	10409233906.18	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。							

1.申购份额包含报告期间内的申购、转换转入以及红利再投。
2.上述份额占比为四舍五入,保留两位小数后的结果。

§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天盈货币市场基金募集注册的文件
(二)《兴业添天盈货币市场基金合同》
(三)《兴业添天盈货币市场基金托管协议》
(四)法律意见书
(五)基金管理人业务资格批件和营业执照
(六)基金托管人业务资格批件和营业执照
(七)中国证监会要求的其他文件
9.2 存放地点
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
二〇一七年四月二十一日

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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2017年1月1日起至3月31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
基金主代码	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