兴业年年利定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2017年10月26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2017年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业年年利定开债券
基金主代码	001019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年02月12日
报告期末基金份额总额	906,200,718.85份
投资目标	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性,通过积极主动的投资管理,在有效保持资产流动性和控制投资风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
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、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等,力求规避风险并实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	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风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,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

§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07月01日-2017年09月30日)
1.本期已实现收益	8,461,670.58
2.本期利润	7,459,542.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金资产净值	946,229,749.08
5.期末基金份额净值	1.044

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。

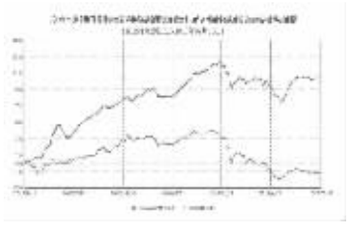
3.2 基金净值表现

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	0.77%	0.06%	-0.15%	0.03%	0.92%	0.03%

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
丁进	本基金的基金经理	2015-07-06	-	7	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2006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3月至2010年10月,在新华信国际信息咨询(北京)有限公司担任企业信用研究高级咨询顾问;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。

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

总体看,债券方面,三季度债券收益率曲线小幅盘升,信用利差维持原有水平,货币市场利率波动显著高于二季度,每个月末资金利率均有较大幅度波动。季度末资金面紧张程度高于市场预期。

报告期内,组合维持中等水平久期和一定比例杠杆,由于资金价格始终维持高位,息差策略效用较低。

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0.77%,同期业绩比较基准收益率为-0.15%。

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	1,450,093,051.85	87.20
	其中:债券	1,399,338,072.40	84.14
	资产支持证券	50,754,979.45	3.05
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	158,094,021.68	9.51
8	其他资产	54,840,316.23	3.30
9	合计	1,663,027,389.76	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。

5.3 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	173,126,000.00	18.30
	其中:政策性金融债	173,126,000.00	18.30
4	企业债券	972,291,072.40	102.75
5	企业短期融资券	65,239,000.00	6.89
6	中期票据	119,164,000.00	12.59
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	69,518,000.00	7.35
9	其他	-	-
10	合计	1,399,338,072.40	147.89

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	112253	15荣盛01	640,000	64,064,000.00	6.77
2	130247	13国开47	600,000	62,160,000.00	6.57
3	170404	17农发04	500,000	48,550,000.00	5.13
4	122337	13魏桥02	470,000	46,769,700.00	4.94
5	136121	15南山02	450,000	44,041,500.00	4.65

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	123510	14吉城04	500,000	50,754,979.45	5.36

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	213,353.57
2	应收证券清算款	19,257,303.70
3	应收股利	-
4	应收利息	33,464,058.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,906,600.00
7	其他	-
8	合计	54,840,316.23

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	906,200,718.85
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	906,200,718.85

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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比(%)
机构	1	20170701-20170930	480,306,436.12	-	-	480,306,436.12	53.00
产品持有风险							

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

2017年8月9日,王意女士担任兴业基金管理有限公司督察长,详见本公司于2017年8月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

§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年年利定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件

(二)《兴业年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》

(三)《兴业年年利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

二〇一七年十月二十六日

兴业收益增强债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2017年10月26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2017年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业收益增强债券	
基金主代码	001257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年05月29日	
报告期末基金份额总额	197,215,368.32份	
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金将密切关注股票、债券以及货币市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济基本面、政策面、流动性、估值与供求等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,确定各类属资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。	
业绩比较基准	本基金采用"中债综合全价指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%"作为投资业绩比较基准。	
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风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,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	
下属分级基金的基金简称	兴业收益增强债券A	兴业收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	001257	001258
报告期末下属分级基金的份额总额	119,932,234.19份	77,283,134.13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07月01日-2017年09月30日) 兴业收益增强债券A	兴业收益增强债券C
1.本期已实现收益	2,268,204.06	1,536,317.73
2.本期利润	2,269,574.17	1,397,975.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.0173	0.0136
4.期末基金资产净值	137,745,011.17	87,737,622.66
5.期末基金份额净值	1.149	1.135

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

兴业收益增强债券A净值表现

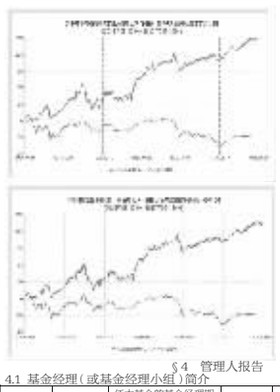
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.59%	0.16%	0.33%	0.06%	1.26%	0.10%

兴业收益增强债券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
过去三个月	1.34%	0.17%	0.33%	0.06%	1.01%	0.11%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率*90%+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



§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
丁进	本基金的基金经理	2015-05-29	-	7	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2006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3月至2010年10月,在新华信国际信息咨询(北京)有限公司担任企业信用研究高级咨询顾问;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。
周鸣	本基金的基金经理;固定收益投资一部总监	2015-05-29	-	16	中国籍,工商管理硕士,具有证券投资基金从业资格。先后任职于天相投资顾问有限公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司从事基金投资、企业年金投资等,2009年加入申万菱信基金管理有限公司担任固定收益部总经理。2009年6月至2013年7月担任申万菱信收益宝货币基金基金经理,2009年6月至2013年7月担任申万菱信添益宝债券基金基金经理,2011年12月至2013年7月担任申万菱信可转债债券基金基金经理,2013年8月加入兴业基金管理有限公司,现任兴业基金管理有限公司固定收益投资一部总监,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

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

总体看,债券方面,三季度债券收益率曲线小幅盘升,信用利差维持原有水平,货币市场利率波动显著高于二季度,每个月末资金利率均有较大幅度波动。季度末资金面紧张程度高于市场预期。

权益市场方面,三季度指数全线上涨,上证指数和创业板指数均有5%以上涨幅,中小板指数上涨13%表现突出,电子板块、通信板块多点开花,呈现出普涨格局。

报告期内,组合在三季度维持此前债券资产配置、权益资产方面对于前期涨幅较大的板块个股做了调整。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类份额净值增长率为1.59%,同期业绩比较基准收益率为0.33%,本基金C类份额净值增长率为1.34%,同期业绩比较基准收益率为0.33%。

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	36,667,150.00	14.03
	其中:股票	36,667,150.00	14.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	209,539,991.20	80.17
	其中:债券	209,539,991.20	80.17
	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	3,785,692.10	1.45
8	其他资产	11,391,646.34	4.36
9	合计	261,384,479.64	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	18,207,500.00	8.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	18,459,650.00	8.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,667,150.00	16.26

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	750,000	10,627,500.00	4.71
2	300070	碧水源	565,000	10,175,650.00	4.51
3	002573	清新环境	380,000	8,284,000.00	3.67
4	000651	格力电器	200,000	7,580,000.00	3.36

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	29,927,000.00	13.27
	其中:政策性金融债	29,927,000.00	13.27
4	企业债券	111,899,191.20	49.63
5	企业短期融资券	20,064,000.00	8.90
6	中期票据	20,220,000.00	8.97
7	可转债(可交换债)	27,429,800.00	12.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	209,539,991.20	92.93

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	1180184	11通化债	200,000	21,098,000.00	9.36
2	101559016	15南国置业MTN001	200,000	20,220,000.00	8.97
3	041651053	16电网CP002	200,000	20,064,000.00	8.90
4	170204	17国开04	200,000	19,960,000.00	8.85
5	112258	15荣盛03	200,000	19,958,000.00	8.85

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 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	54,013.19
2	应收证券清算款	7,400,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,910,369.24
5	应收申购款	27,263.91
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,391,646.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	名称	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	132006	16皖新EB	4,459,840.00	1.98

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	兴业收益增强债券A	兴业收益增强债券C
报告期期初基金份额总额	135,992,555.43	132,844,209.22
报告期期间基金总申购份额	43,737,130.72	7,374,796.96
减:报告期期间基金总赎回份额	59,797,451.96	62,935,872.05
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	119,932,234.19	77,283,134.13

注:申购份额含红利再投、转换入份额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

2017年8月9日,王意女士担任兴业基金管理有限公司督察长,详见本公司于2017年8月11日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

§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收益增强债券型证券投资基金募集注册的文件

(二)《兴业收益增强债券型证券投资基金基金合同》

(三)《兴业收益增强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

二〇一七年十月二十六日

兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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:2017年10月26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10月23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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业成长动力混合
基金主代码	002597
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月03日
报告期末基金份额总额	50,488,181.51份
投资目标	本基金通过灵活的资产配置,基于对企业内在价值的深入研究,重点投资于质地优秀且未来预期成长性良好的上市公司,在充分控制风险和保证流动性的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将结合国内外宏观经济环境、货币财政政策形势、证券市场走势的综合分析,主动判断市场时机,进行积极的资产配置,确定在不同时期和阶段基金在股票、债券等各类资产的投资比例,以最大限度地降低投资组合的风险、提高投资组合的收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。
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07月01日-2017年09月30日)
1.本期已实现收益	566,131.25
2.本期利润	687,723.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0134
4.期末基金资产净值	52,070,379.90
5.期末基金份额净值	1.031

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。

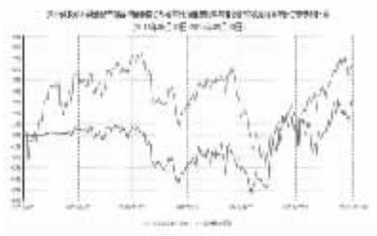
3.2 基金净值表现

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	1.38%	0.62%	4.44%	0.51%	-3.06%	0.11%

注:本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率*55%+中证全债指数收益率*45%。

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:本基金基金合同于2016年6月3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使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§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	离任日期	证券从业年限	说明
刘方旭	本基金的基金经理	2016-06-03	-	8	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2003年4月至2007年6月,先后就职于上海济国投资管理有限责任公司、上海英代科斯投资管理有限责任公司、上海上东投资管理有限责任公司,担任研究员;2007年7月至2009年6月,在瑞穗投资咨询(上海)有限公司担任分析师;2009年6月至2012年5月,在中欧基金管理有限公司担任研究员、基金经理助理,其中2010年担任中欧中小盘股票型证券投资基金基金经理助理,2011年担任中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理;2012年5月至2015年5月,在中国人保资产管理股份有限公司股票投资部担任投资经理;2015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

三季度以来,上证综指与创业板指均呈现上涨趋势,创业板指涨幅略小,本基金通过积极调仓,试图把握市场