

基金管理人: 兴业基金管理有限公司

报告送出日期:2017年10月26日 § 1 重要提示 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

朝时4利/5度14年17月以上中以上。 中国工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: 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

《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 | 9,993,615,184.79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 | 本基金测过对求规经济,用零走势,完全往来,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 属资产配置旗略、久削镇略、或益率曲线旗略,信用债 投资旗略等,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 |

3.1 主要财务指标

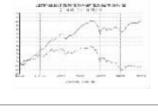
| 报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日) | 主要财务指标 |
|--------------------------------|----------------|
| 71,392,543.39 | 1.本期已实现收益 |
| 107,261,909.44 | 2.本期利润 |
| 0.0107 | 3.加权平均基金份額本期利润 |
| 10,089,134,707.14 | 4.期末基金资产净值 |
| 1.010 | 5.期末基金份额净值 |

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 2-4

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



兴业添利债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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鸭日期,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

。 3、本基金的基金经理杨逸君女士因个人原因(休产假)休假超过 30 日,本 公司根据有关法规和公司制度批准杨逸君女士于2017年5月4日开始休假并进行 公告。杨逸君女士休假期间,本基金的投资管理工作由基金经理莫华寅代为履行 职责。杨逸君女士已结束休假,于2017年9月11日起恢复履行基金经理职务。

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,为基金份额持有人读求最大利益。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 1.宏观经济分析

动的比较

国外经济方面、三季度世界经济增长动力较上季度有所强化。主要经济体经济走势良好,美国经济和欧元区经济增长趋势改善。从领先指标来看,9月美国ISM制造业PMI指数上升至60.8,创新阶段新高。就业市场持续改善,失业率继续 7. 加州河區北 (加州西東) (1987年) (1987474) (1987474) (1987474) (1987474) (1987 58.1,通胀依然受抑制,9月CPI同比增速稳定在1.5%,在油价上涨动能趋缓下,通 56.1、通路下水交对响。另介证明与5月生活及20年11.20。11.1001.1.1030用记录 F. 通 胀或继续受力响。美元指数本季度从96下降到低点301附近,进入9月有所走强,回 升至93,在四季度美联储缩表操作大背景下,美元走强仍有较强支撑;

国内经济方面,当前我国经济金融运行总体平稳,三季度经济增长较前两季 度小幅放缓。具体来看,领先指标制造业PMI小幅回落后于9月回升至52.4的水平,同步指标工业增加值 1-8月累计同比增速6.7%,逐步走低。从经济增长动力 来看,拉动经济的二驾马车涨跌互观:1-8月,社会消费品零售累计增速上升至 104%,固定资产投资累计增速大幅回落至7.8%,进出口总额累计增速逐步回落 至11.7%。通胀方面,CPI同比保持稳定,9月CPI维持1.60%;PPI超预期回升,9月 PPI至6.90%水平。

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

THE RESERVE OF THE PARTY OF THE

NAMES OF APPLICATIONS ASSESSED.

限公司。現在基金於理。

1、对基金於理的首任基金於理,其"任职日期"为基金合同主致任。"高取日期"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金於理外。"任职日期"为基金合同主致任。"高取日期"为根据成立决定确定的聘任日期取解申日期;
2、证券从业的含文理从行业协会(证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。
3、本基金的基金经理检查者女士无可718年10日年增纳依果并往7公生,接给募女士无规则同,大基保职公司制度比核检查基女士无到718年10日年增纳依果并往7公生,接给募女士依据则同,本基金的投资管理工作由基金於理常志强代为履行职责。杨逸君女士已结束休假,于2017年9月11日超恢复履行基金於理职务。

4.2 管理人对报告期内本基金运作選與守信情况说明 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 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

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

施司游艇加上,分别能以1000时时,入场水域大小加。1成口79073,外需业域1户38户自在口水,水及水 频等基金特有人利益的行为。 4.3 公平交易专项说明 4.3 1、公平交易制度的技行情况 报告前内,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 善相应制度和能遇,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

1.宏观经济分析 到外经济方面;三季度世界经济增长动力较上季度有所强化。主要经济体经济走势良好, 美国经济和欧元区经济增长趋势改흥。从领先指标来看,5月美国ISM制造业PMI指数上升至 608,创新阶段新高。就业市场持续改善,失业率继续小幅下行至4.2%左右。但通胀依然难有起

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

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。

债券市场方面,三季度中债总全价指数下跌0.42%,中债银行间国债全价指 数下跌0.71%,中债企业债总全价指数下跌1.76%。具体来看,10年期国债收益率 从3.57%的水平上行了4个BP至3.61%,10年期金融债(国开)收益率从4.20%下 行1个BP至4.19%。货币市场方面,三季度,在银监会强监管的背景下,央行货币政策整体保持不紧不松,资金面波动较前两季度改善,整体平稳。银行间1天回购 利率收至2.96%,7天回购利率收至3.20%。 3. 运行分析

报告期内,本组合严格把握债券的信用风险,严格执行短久期策略,谨慎杠 杆操作,准确把握信用资质较好的债券品种的投资机会,适当降低债券仓位,并

在季度末等关键时点接的进行逆回胸操作以增厚组合收益。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,

适当拉长组合久期,择机配置部分高等级信用债。 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1.09%,同期业绩比较基准收益率为-0.

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

本报古期内,本基金不存住建筑一下了上作户 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

| 序号 | 项目 | 金額(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 | 8,590,292,000.00 | 85.08 |
| | 其中:债券 | 7,852,862,100.00 | 77.78 |
| | 资产支持证券 | 737,429,900.00 | 7.30 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买人返售金融资产 | 1,302,945,194.41 | 12.90 |
| | 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 | 1,172,720.29 | 0.01 |
| 8 | 其他资产 | 202,095,741.32 | 2.00 |
| 9 | 合计 | 10,096,505,656.02 | 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

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

债券品种 公允价值(元)

| | | | (76) |
|----------|-------------|------------------|-----------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 750,475,000.00 | 7.44 |
| | 其中:政策性金融债 | 549,255,000.00 | 5.44 |
| 4 | 企业债券 | 6,247,714,500.00 | 61.93 |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,227,000.00 | 0.70 |
| 6 | 中期票据 | 310,509,600.00 | 3.08 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | 373,392,000.00 | 3.70 |
| 9 | 其他 | 100,544,000.00 | 1.00 |
| 10 | 合计 | 7,852,862,100.00 | 77.83 |
| E E 4012 | 上期士松八厶仏店上甘。 | 今次であ店レ加上ホモ | 比較的設工力再类权 |

| 字号 | 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 | 170207 | 17国开07 | 3,500,000 | 348,915,000.00 | 3.46 |
| 2 | 1622025 | 16中银消费债 | 2,000,000 | 201,220,000.00 | 1.99 |
| 3 | 1580078 | 15株今添债 | 1,600,000 | 163,440,000.00 | 1.62 |
| 4 | 1080181 | 10南宁城投债 | 1,500,000 | 159,150,000.00 | 1.58 |
| 5 | 130203 | 13国开03 | 1,500,000 | 150,300,000.00 | 1.49 |

报告期末按公允价值占基金资产净值 资明细

木其全木招告即末去挂有贵全届 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

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

5.11.1 报台则内, 华基立仅仅快乘柜户行合相大広律広观的要求, 木及现本基金投资的前十名证券的发行主体本明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。

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

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 | 序号 | 持有基金 份額比例 达到或者 超过20% 的时间区 间 | 期初份額 | 申购份額 | 赎回份額 | 持有份額 | 份報 占占 (%) |
|-------|----|--|----------------------|--------|------|----------------------|-----------------|
| 机构 | 1 | 20170701 -2017093 0 | 9,993,440, 595.27 | 0.00 | 0.00 | 9,993,440, 595.27 | 100 |
| | | | | 产品特有风险 | | | |

上述份额占比为四舍五人,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,王慧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。

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

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

基金管理人:兴业基金管理有限公司 报告送出日期:2017年10月26日 § 1 重要提示

§ 2 基金产品概况

實事保证本报告所裁資料不存在進假记载、误导性筛述或值大週間,并次 完整生學很予別及在物程上。 提起有限公司服務本基本心中 ······ 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

2.1 基金基本情况

| 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 | 10,623,399,243.72(2) | | |
| 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 余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和 法在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳 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局种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基及股票型基金。 | | |
| 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 | 64,083.05份 | 10,623,335,160.67份 | |

3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2017年07) | 报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日 | | |
|------------|--------------|-------------------------------|--|--|
| 土安则为旧怀 | 兴业添天盈货币A | 兴业添天盈货币B | | |
| 1.本期已实现收益 | 655.20 | 111,936,657.39 | | |
| 2.本期利润 | 655.20 | 111,936,657.39 | | |
| 3.期末基金资产净值 | 64,083.05 | 10,623,335,160.67 | | |

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 险相关费用后的金额。 太期利润为太期已实现收益加上太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

3.2.1 本报告期基金价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净值表现

| 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 | 1.0030% | 0.0030% | 0.3403% | 0.0000% | 0.6627% | 0.0030% |
| 兴业添天盈 | 货币B净 | 值表现 | | | | |
| | 266-681196r | 净值收 | JIF6814-87:310 | 业绩比较基准 | | |

注:1、本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后

兴业添天盈货币市场基金

2017年第三季度报告

色,8月PCE和核心PCE通账当月同比分别下行至1.43%和12.29%左右。成元区制造业PMI指数回商高于9月上行至681,通胀依然受抑制。9月CP间比增速稳定在1.5%,在油价上涨动能趋级下,通胀或燃烧受抑制。更元指数本季度从96下降到低点91附近,进入9月有所走强。同户至93,在四季度或除储储装操件大劈官下。烧土港份有较强变。国内经济方面,当前我国经济金融运行总体平稳,三季度经济增长较前两季度小幅放缓。具体来看,领先指标前造业PMI小桶间商店于9月回于至62.4的水平。而步指标工业增加值1.8月累计旧世增45%。实上更46、从经济增长为1来看,边水经济的三级与不振发更过。

口总额累计增速逐步回落至11.7%。通胀方面,CPI同比保持稳定,9月CPI维持1.60%;PPI超和 期回升,9月PPI至6.90%水平。 债券市场方面,三季度中债总全价指数下跌0.42%,中债银行间国债全价指数下跌0.71%

中债企业债总全价指数下跌1.76%。具体来看,10年期国债收益率从3.57%的水平上行了4个 BP至3.61%,10年期金融债(国开)收益率从4.20%下行1个BP至4.19%。货币市场方面,三季 变,在银监会强监管的背景下,央行货币政策整体保持不紧不松,资金面波动较前两季度改 善,整体平稳。银行间1天回购利率收至2.96%,7天回购利率收至3.20%。

取较为稳健的操作策略 4.5 报告期内基金的业绩表现

§ 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 | 金額(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|------------------------|-------------------|------------------|
| 1 | 固定收益投资 | 8,571,632,855.99 | 80.65 |
| | 其中:债券 | 8,571,632,855.99 | 80.65 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买人返售金融资产 | 383,227,214.84 | 3.61 |
| | 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 | 1,640,971,739.34 | 15.44 |
| 4 | 其他资产 | 31,997,214.02 | 0.30 |
| 5 | 会计 | 10,627,829,024.19 | 100.00 |

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%。

报告期内投资组合平均剩全期限超过120天情况说

济走势良好,美国经济和欧元区经济增长趋势改善。从领先指标来看,9月美国

ISM制造业PMI指数上升至60.8、创新阶段新高。就业市场持续改善、失业率继续

小帽下行至4.2%左右。但通胀依然操有起色,8月PCB和核心PCE通胀当月同比分别下行至1.43%和1.29%左右。欧元区制造业PMI指数回落后于9月上行至581,通胀依然受抑制,9月CPI同比增速稳定在1.5%,在油价上涨动能趋缓下,通

胀或继续受抑制。美元指数本季度从96下降到低占91附近,进入9月有所走强,同

所以他多交叉中间。 升至93,在四季度美联储器表操作大声量下,美元进强仍有较强支撑; 国内经济方面,当前我国经济金融运行总体平稳,三季度经济增长较前两季 度小幅放缓。具体来看,领先指标制造业PMI小幅回落后于9月回升至52.4的水 平,同步指标工业增加值 1-8月累计同比增速67%,逐步走低,从经济增长动力来看,拉动经济的三驾马车涨跌互现:1-8月,社会消费品零售累计增速上升至10.4%,固定资产投资累计增速大幅回落至7.8%,进出口总额累计增速逐步回落

至11.7%。通胀方面,CPI同比保持稳定,9月CPI维持1.60%;PPI超预期回升,9月

政策整体保持不紧不松,资金面波动较前两季度改善,整体平稳。银行间1天回购

理人在策略上,保持久期和杠杆的灵活性,在9月的反弹行情中逐步拉长久期,适 建八红果础工, 4457人纳州北广印及哈庄, 4257印及平11间干燥之机 K入纳, 42 当进行杠杆操作, 对中长人期信用使和长期限和零估的投资机会进行合理参与, 同时密切关注债市情绪的动向, 择机调整配置力度。下阶段将继续严格把控信用

风险, 选择资质较优的债券配置, 根据市场情绪变化相机抉择配置速度和组合久

报告期内,本基金份额净值增长率为0.92%,同期业绩比较基准收益率为-0. 。 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

§ 5 投资组合报告

3,620,263,46

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

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。

期,目前久期保持中性,杠杆维持在合理水平。 4.5 报告期内基金的业绩表现

百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

4 贵金属投资

报告期末基金资产组合情况

债券市场方面,三季度中债总全价指数下跌0.42%,中债银行间国债全价指

(中:剩余存续期超过

摊余成本(元)

| | | | | | | (%) |
|-------|---------------|---------------------|-----------|----------|---------|------------------|
| 1 | 国家债券 | | - | | | - |
| 2 | 央行票据 | | | - | | - |
| 3 | 金融债券 | | 851,237 | ,601.25 | | 8.01 |
| | 其中:政策性金融 | 換價 | 851,237 | ,601.25 | | 8.01 |
| 4 | 企业债券 | | | - | | - |
| 5 | 企业短期融资券 | | 319,716 | , 196.17 | | 3.01 |
| 6 | 中期票据 | | | - | | - |
| 7 | 同业存单 | | 7,400,679 | ,058.57 | | 69.66 |
| 8 | 其他 | | | - | | _ |
| 9 | 4 | htt . | 8,571,632 | ,855.99 | | 80.69 |
| 10 | 剩余存续期超过 债券 | 397天的浮动利率 | | - | | - |
| 5.6 报 | 告期末按摊余 | 成本占基金资产的 | • 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 | 111714268 | 17 江 苏 银 行 CD268 | 6,000,000 | 574,060 | ,301.72 | 5.40 |
| 2 | 111709289 | 17 浦 发 银 行 CD289 | 5,000,000 | 499,368 | ,688.92 | 4.70 |
| 3 | 111708318 | 17 中 信 银 行 CD318 | 4,500,000 | 431,128 | ,380.67 | 4.06 |
| 4 | 111680456 | 16哈尔滨银行 CD043 | 3,700,000 | 367,644 | ,478.27 | 3.46 |
| 5 | 170207 | 17国开07 | 3,500,000 | 349,216 | ,418.56 | 3.29 |
| 6 | 111708276 | 17 中信银行 CD276 | 3,000,000 | 298,386 | ,427.92 | 2.81 |
| 7 | 111681339 | 16重庆农村商行 CD154 | 3,000,000 | 297,520 | ,356.54 | 2.80 |

111711360 '影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值 偏离情る 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

5.9.1 基金计价方法说明 本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买人成本列示,按票面利率或商定利率并考 度其买人时的融价与折价,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价值维持在 100 元。 59.2 报告则内,本基金投资决策和评价专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通 责人组的情况。 5.9.3 其他资产构成

记不能工作。例如2014年6月20日 1802年6月20日 报告期内工作偶氮度的绝对值达到0.55情况识明 本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。 58 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 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明组 。 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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过200

持有份額 10,622,156, 976,71

,申购份额包含报告期间内的申购、转换转人以及红利再投

1.申聯份報信長信期间内的申助、转換转人以及红利再投。 2.上述份數由比为四帝五人,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 5.2 影响投资者决策的其他重要信息 5.3 影响分子,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蒸烧管理人员变更公告》。 5.9 备查文件目录

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基金合同》

基金管理人、基金托管人的住所

5.11.3 其他资产构成

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

f:http://www.cib_fund.com.cn 注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。 P服务中心电话 400099561

兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金 2017年第3季度报告 2017年09月30日 基金管理人:兴业基金管理有限公司

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1 組織性和完整性來担个別及定帶责任。 上海浦东发展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 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,误导性的

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

| § 2 | 基金产品概况 |
|------------|--|
| 2.1 基金基本情况 | |
| 基金简称 | 兴业瑞丰6个月定开债券 |
| 基金主代码 | 004141 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,999,999,941.40% |
| 投资目标 | 在严格保持资产流动性和控制投资风险的前提下, 过积极主动的投资管理, 迫求基金资产的长期稳健 值。 |
| 投资策略 | 封河間內,本基金會在基金合同的定的與稅間期內, 过程发现经济市稅。 国家货币效量 和财政的股份 资金债额物况的研究, 把握大营资产的原则收益率, 表水平、风险水平、在有效物则的资格量上, 边场 整备全大类资产的投资比例, 力争为基金资产获取 健阳限, 开发的分子。在增不基金有关投资领制与设 设施的提供。在增不基金有关投资领制与设 行政的推供。将上型投资产高级为性的资品。 |
| 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 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风 的基金品种,其预期风险与预期收益高于货币市场! 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 |

3.1 主要财务指标

| 主要财务指标 | 报告期(2017年07月01日 - 2017年09月30日) |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期巳实现收益 | 26,721,867.50 |
| 2.本期利润 | 27,741,393.49 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0092 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,067,408,909.04 |
| 5.期末基金份額净值 | 1.0225 |

《3 主要财务指标和基金净值表现

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,计人费用后

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 阶段 1)-(3)

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

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 实际收益水平要低于所列数字。 3.2 基金净值表现

兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金

Charles from editorior and a track, we describe the con-注:1、本基金基金合同于2017年3月23日生效,截至报告期末本基金基金合

※4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 基金的 基金经理 其"任职日期"为基金合同生效日 "察职日 央定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日据公司决定确定的聘任日期和解聘日期:

42 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。本着该实信用、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,为基金份额持有人读来最大利益。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 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。公平对持版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

%ULE。 3.本基金的基金经理杨逸君女士因个人原因(休产假)休假超过30日,本公司根据有关法规和公司制度批准杨逸君女士于2017年5月4日开始休假并进行公告。杨逸君女士水假胡同、本基金的投资管理工作由基金经理全理继续履行职责。杨逸君女士已结束休假,于2017年9月11日起恢复履行基金经理职务。

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

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

国外经济方面,三季度世界经济增长动力较上季度有所强化。主要经济体经

 运行分析 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,增加了同业存单的配 置比例,并适当拉长组合剩余期限,在季度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,根 据货币基金流动性新规要求,严格把控各项指标。在警惕流动性以及信用风险的大前提下,采

4.3 稅空則均每並即並請表現 报告期內,本基金A裝份額净值收益率为1,0030%,同期並請比较基准收益率为0,3403%, 本基金B裝份額净值收益率为1,0040%,同期並請比较基准收益率为0,3403%。 4.6 报告期內基益持有人數或基金资产净值预整说明 水程告期內,本基金不存在连续二十个工作日基金份額持有人數量不满二百人或者基金等之物值每年至五百的始點。

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

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

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

数下跌0.71%,中债企业债总全价指数下跌1.76%。具体来看,10年期国债收益率从3.57%的水平上行了4个BP至3.61%,10年期金融债(国开)收益率从4.20%下行1个BP至4.19%。货币市场方面,三季度,在银监会强监管的背景下,央行货币 数量(张) 公允价值(元 和率收至20%,7天回购利率收至320%。 3. 运行分析 报告期内,债市呈现振荡市特点,收益率振荡上行后有所回落;而本基金,管 1,000,000

> 证券代码 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权 资明细

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

5.6 报告期末按公允价值占基金资产

本基金本报告期末未持有贵金属

5.10.1 本期国债期货投资政策

5.11 投资组合报告附注

制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资范围不包含股票。

证券投资明细

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。

5.11.1 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 9.2 存放地点 基金管理人、基金托管人的住所

兴业基金管理有限公司

審並自律、審並北自入印江州 93 查阅方式 投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。 网络:http://www.cib-fund.com.cn 投资者对本报告书如有疑问,可答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

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

告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-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

注:总申则价额管注利申投,转换人价额,总规则价额管转换性。
7. 基金管理人法同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法同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
9 1 据法里时尚,必该季转专其全公额标例未到是47720000 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

持有份額 2,999,999 2,999,999, 000.00

上述份额占比为四舍五人,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,王薏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)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募集注

以下 (二)(米业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》 (三)(米业瑞丰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