兴业稳固收益两年理财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06月10日
报告期末基金份额总额	1,848,025,938.71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（2017年07月01日－2017年09月30日）
1.本期已实现收益	17,312,871.43
2.本期利润	17,312,871.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094
4.期末基金资产净值	1,870,629,134.03
5.期末基金份额净值	1.012

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。

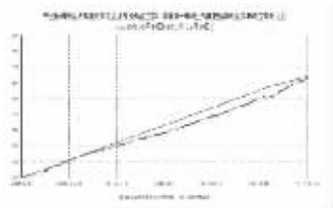
3.2 基金净值表现

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	0.90%	0.03%	0.50%	0.00%	0.40%	0.03%

注: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）。

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		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	2015-11-09	-	7	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。

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雷志强代为履行职责。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

1.宏观经济分析

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,失业率继续小幅下行至4.2%左右。但通胀依然难有起色,8月PCE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,通胀或继续受抑制。美元指数本季度从96下降到低点91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PPI至6.90%水平。

2.市场回顾

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,组合进行第二个封闭期的建仓工作,谨慎杠杆操作,严格把握债券的信用风险,根据本组合投资策略要求,陆续配置到期日在下一个封闭期前到期的债券,并在季度末等关键时点择时进行逆回购操作以增厚组合收益。目前组合久期在一年以内。

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,重点做好建仓及流动性管理工作,防范信用风险，在严格遵守投资策略的情况下,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0.90%，同期业绩比较基准收益率为0.50%。

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	1,601,317,139.62	85.54
	其中:债券	1,372,652,080.24	73.33
	资产支持证券	228,665,059.38	12.22
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	239,165,278.75	12.78
	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	7,681,118.08	0.41
8	其他资产	23,828,706.76	1.27
9	合计	1,871,992,243.21	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	391,920,201.50	20.95
	其中:政策性金融债	391,920,201.50	20.95
4	企业债券	81,948,356.71	4.38
5	企业短期融资券	360,044,232.98	19.25
6	中期票据	391,613,728.35	20.93
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	147,125,560.70	7.87
10	合计	1,372,652,080.24	73.38

注:其他为地方政府债券。

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	150309	15进出09	1,500,000	149,961,234.43	8.02
2	101651005	16中石油MTN001	1,500,000	147,615,618.27	7.89
3	170204	17国开04	1,300,000	129,355,332.51	6.92
4	1605197	16宁夏债05	1,000,000	98,030,686.74	5.24
5	1182216	11中海运MTN2	900,000	91,507,356.38	4.89

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	1789036	17湘元1A2	875,000	69,489,499.98	3.71
2	1789010	17苏租1A2	680,000	50,541,903.14	2.70
3	1689281	16龙元2B	350,000	34,340,702.83	1.84
4	1789013	17光盐1A	400,000	29,657,132.24	1.59
5	1689292	16惠益1B	300,000	29,633,167.28	1.58
6	1789078	17福元1B	150,000	15,002,653.91	0.80

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	16,199.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,812,507.44
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,828,706.76

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	1,848,025,938.71
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	1,848,025,938.71

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	20170701-20170930	1,847,999,000.00	-	-	1,847,999,000.00	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

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稳固收益两年理财债券型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业稳固收益两年理财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

兴业福益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:上海银行股份有限公司
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。
基金托管人上海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	兴业福益债券
基金主代码	002524
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年03月18日
报告期末基金份额总额	200,022,989.71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	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	上海银行股份有限公司

§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	654,394.02
2.本期利润	1,460,992.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0073
4.期末基金资产净值	200,410,953.88
5.期末基金份额净值	1.002

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。

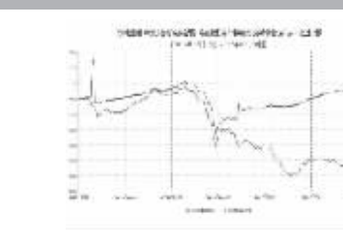
3.2 基金净值表现

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	0.70%	0.04%	-0.15%	0.03%	0.85%	0.01%

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐青	本基金的基金经理	2017-05-09	-	6	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8月担任国联安德盛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。

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

报告期内,基于对经济基本面、通胀水平、货币政策方向、债券绝对收益率水平、信用利差状况等多方面综合考虑,对各类细分资产的风险和收益率预期变化进行动态调整。

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0.70%,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	193,323,513.72	96.30
	其中:债券	174,384,400.00	86.86
	资产支持证券	18,939,113.72	9.43
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	3,252,729.84	1.62
8	其他资产	4,178,937.50	2.08
9	合计	200,755,181.06	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	134,317,000.00	67.02
	其中:政策性金融债	116,218,000.00	57.99
4	企业债券	21,934,200.00	10.94
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	18,133,200.00	9.05
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	174,384,400.00	87.01

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	160215	16国开15	900,000	87,246,000.00	43.53
2	160312	16进出12	200,000	18,998,000.00	9.48
3	1382046	13津港股MTN1	180,000	18,133,200.00	9.05
4	1322002	13招银租赁02	180,000	18,099,000.00	9.03
5	1580253	15国网债05	180,000	17,933,400.00	8.95

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	131874	电力新能源02	110,000	10,918,720.55	5.45
2	116132	深南优09	80,000	8,020,393.17	4.00

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	662.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,178,274.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,178,937.50

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	200,022,994.18
报告期期间基金总申购份额	1,293.20
减:报告期期间基金总赎回份额	1,297.67
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	200,022,989.71

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	20170701-20170930	200,000,000.00	0.00	0.00	200,000,000.00	99.99
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

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福益债券型证券投资基金募集注册的文件

（二）《兴业福益债券型证券投资基金基金合同》

（三）《兴业福益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

兴业福鑫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:北京银行股份有限公司
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。
基金托管人北京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	兴业福鑫债券
基金主代码	004140
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年03月10日
报告期末基金份额总额	2,099,239,331.05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	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险的基金品种，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	北京银行股份有限公司

§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	19,578,997.35
2.本期利润	19,358,966.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0092
4.期末基金资产净值	2,110,025,375.02
5.期末基金份额净值	1.0051

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。

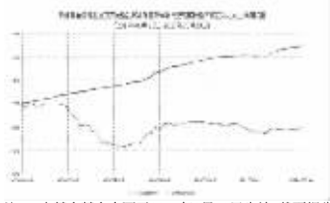
3.2 基金净值表现

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	0.92%	0.02%	-0.15%	0.03%	1.07%	-0.01%

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

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2017年3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,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		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	2017-03-10	-	7	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;

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

1.宏观经济分析

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,失业率继续小幅下行至4.2%左右。但通胀依然难有起色,8月PCE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,通胀或继续受抑