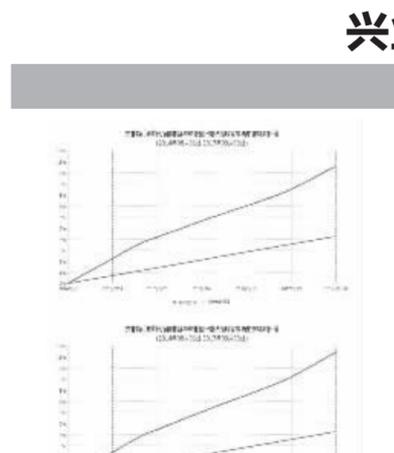


兴业货币市场证券投资基金

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
基金管理人及基金托管人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。



报告期末未发现本基金存在异常交易行为。
4 报告期内基金的投资策略和运作分析
三季度经济与通胀水平整体表现比较平稳,央行继续维持稳健中性的货币政策。

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 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 and 报告期(2017年07月01日-2017年09月30日). Rows include 本期累计净利润, 本期累计公允价值变动收益, etc.

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。

3.2.1 本基金收益分配方式
3.2.2 本基金收益分配日期
3.2.3 本基金收益分配比例

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists fund managers and their terms.

中国银监会于2017年9月27日核准王瑞林担任兴业基金基金经理,自2017年10月1日起生效。

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0.9402%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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元的情形。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 类别 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 类别, 公允价值(元). Lists asset categories and their values.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 行业名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 公允价值(元). Lists industry investments.

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平均值。

5.3 基金投资组合平均剩余期限基本情况
5.3.1 投资组合平均剩余期限
5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with 3 columns: 序号, 平均剩余期限, 高流动性资产占基金资产净值的比例(%)

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

3.2.1 本基金收益分配方式

3.2.2 本基金收益分配日期
3.2.3 本基金收益分配比例

注:1.本基金的业绩比较基准为:中国民生银行公布的金融机构人民币七天通知存款基准利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来,以基金资产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



1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

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 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况说明
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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

兴业裕恒债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

注:1.本基金基金合同于2016年11月4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约定,基金管理人自基金合同生效之日起6个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

4.1 基金经理 (或基金经理小组) 简介
姓名 职务 任职日期 离任日期

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期. Lists fund managers.

中国银监会于2016年11月14日核准王瑞林担任兴业基金基金经理,自2016年11月14日起生效。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况说明
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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

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
4.5 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 类别, 公允价值(元). Lists asset categories.

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

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 公允价值(元). Lists industry investments.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists bond investments.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists asset-backed investments.

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况说明
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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

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
4.5 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 类别, 公允价值(元). Lists asset categories.

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

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 公允价值(元). Lists industry investments.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists bond investments.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists asset-backed investments.

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况说明
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。

4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
4.3.2 异常交易行为的专项说明

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
4.5 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 类别, 公允价值(元). Lists asset categories.

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

Table with 3 columns: 序号, 行业名称, 公允价值(元). Lists industry investments.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5.4.1 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债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists bond investments.

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

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元). Lists asset-backed investments.

5.11.3 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

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。

5.11.6 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

5.11.7 其他资产构成

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

Table with 3 columns: 序号, 资产名称, 公允价值(元). Lists other assets.

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 3 columns: 基金份额, 期初, 期末. Shows share changes.

注:申购份额含红利再投、转换入及分拆份额调增份额,赎回份额含转换转出及分拆份额调减份额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额, 交易品种. Lists transactions.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 投资者名称, 持有基金份额比例, 期初, 期末. Lists investors.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8.2 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》。

5.9 备查文件目录
(一)中国证监会准予货币市场证券投资基金募集注册的文件

(二)《兴业货币市场证券投资基金基金合同》
(三)《兴业货币市场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。
客户服务电话:4000095661

兴业基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

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。

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 3 columns: 基金份额, 期初, 期末. Shows share changes.

注:申购份额含红利再投、转换入及分拆份额调增份额,赎回份额含转换转出的份额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额, 交易品种. Lists transactions.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 投资者名称, 持有基金份额比例, 期初, 期末. Lists investors.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8.2 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》。

5.9 备查文件目录
(一)中国证监会准予兴业裕恒债券型证券投资基金募集注册的文件

(二)《兴业裕恒债券型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业裕恒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。
客户服务电话:4000095661

兴业基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

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。

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 3 columns: 基金份额, 期初, 期末. Shows share changes.

注:申购份额含红利再投、转换入及分拆份额调增份额,赎回份额含转换转出的份额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额, 交易品种. Lists transactions.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 投资者名称, 持有基金份额比例, 期初, 期末. Lists investors.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8.2 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》。

5.9 备查文件目录
(一)中国证监会准予兴业裕恒债券型证券投资基金募集注册的文件

(二)《兴业裕恒债券型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业裕恒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。
客户服务电话:4000095661

兴业基金管理有限公司
二〇一七年十月二十六日

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。

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 3 columns: 基金份额, 期初, 期末. Shows share changes.

注:申购份额含红利再投、转换入及分拆份额调增份额,赎回份额含转换转出的份额。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 5 columns: 序号, 交易方式, 交易日期, 交易金额, 交易品种. Lists transactions.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
5.8.1 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

Table with 5 columns: 投资者名称, 持有基金份额比例, 期初, 期末. Lists investors.

注:本基金收益分配方式为按日结转份额,本报告期基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为1,773,731.43份,金额为2,173,731.43元,适用费率为0。

5.8.2 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》。

5.9 备查文件目录
(一)中国证监会准予兴业裕恒债券型证券投资基金募集注册的文件

(二)《兴业裕恒债券型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业裕恒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。
客户服务电话: