兴业货币市场证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

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:2015年7月20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2015年7月17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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业货币	
交易代码	000721	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年8月6日	
报告期末基金份额总额	8,165,064,053.53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	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业货币A	兴业货币B
下属分级基金的交易代码	000721	000722
报告期末下属分级基金的份额总额	1,984,636,058.12份	6,180,427,995.41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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)	
	兴业货币A	兴业货币B
1. 本期已实现收益	20,899,371.74	79,602,978.16
2.本期利润	20,899,371.74	79,602,978.16
3.期末基金资产净值	1,984,636,058.12	6,180,427,995.41

注: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

兴业货币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	0.9495%	0.0023%	0.3366%	0.0000%	0.6129%	0.0023%

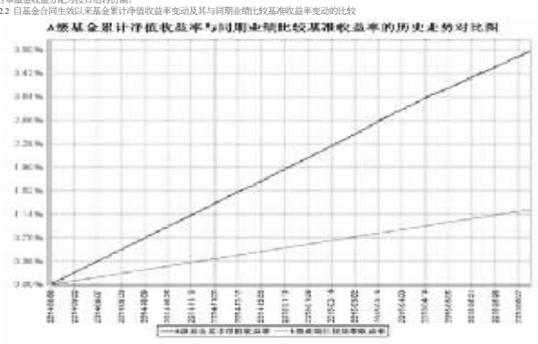
注:本基金收益分配为按日结转份额。

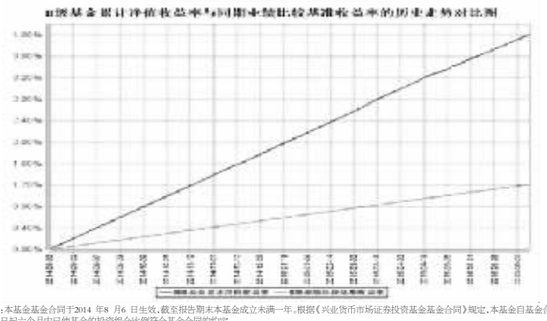
兴业货币B

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	1.0102%	0.0023%	0.3366%	0.0000%	0.6736%	0.0023%

注: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





注:本基金基金合同于2014年8月6日生效,截至报告期末本基金成立未满一年,根据《兴业货币市场证券投资基金基金合同》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		
朱文辉	本基金的基金经理	2014年8月6日	-	13	中国籍,硕士学历,具有证券投资基金从业资格,先后任职于平安保险集团投资管理中心、生命人寿保险股份有限公司资产管理部、汇丰晋信基金管理有限公司和大成基金管理有限公司从事债券投资和基金投资管理,2008年12月至2010年12月任汇丰晋信平稳增利债券基金基金经理,2011年6月至2013年11月任大成保本混合基金基金经理,2011年11月至2013年11月任大成可转债增强债券基金基金经理,2012年6月至2013年11月任大成景恒保本混合型基金基金经理,2013年12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基金经理。

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年二季度,海外发达经济体缓慢回升,美联储推迟升息,希腊债务违约事件风险加大,主要经济体继续维持宽松货币政策,市场动荡加剧。国内经济方面,固定资产投资回落,消费乏力,出口也低于预期,结合货币和社融数据来看,经济增长仍处下滑过程,通胀水平处于低位,央行持续通过降准、降息、公开市场和MLF等保持货币信用环境宽松。

二季度,债券市场先涨后跌,信用利差继续收窄至历史低位,由于央行对冲力度加大,市场资金利率水平显著下降,R007中枢下跌至2.49%,为2011年5月以来最低。

报告期内,基于对整体经济和资金市场的总体判断:在资产配置上,本货币基金首先维持流动性较好且收益稳定的短期银行存款合理比例,同时,积极加大配置资质优良且收益良好的短期融资券,在保持较高流动性的同时提高组合的收益水平。

4.4.2 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 0.9495%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%;本基金B类份额净值收益率为 1.0102%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一个季度,经济下行压力依然较大,政策宽松力度或将加码。在基期效应的作用下,预计二季度经济增长弱反弹,而总需求依然偏弱,通胀回升力度有限。货币政策仍将保持宽松,降准和降息措施均有可能。预计在整体资金面上,R007中枢将持续低位运行,但需警惕季节性因素对资金面的阶段性冲击。

三季度本基金将加大短期银行存款的配置比例,保持期限匹配和组合流动性,同时增持资质优良的短期融资券比例,力争在保证流动性的前提下提高组合收益,做到流动性、安全性和收益性的有机统一,为基金持有人提供稳定的收益回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

-

§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	2,630,441,693.20	32.20
	其中:债券	2,630,441,693.20	32.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,275.00	0.61
	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	5,404,395,681.87	66.16
4	其他资产	84,189,678.37	1.03
5	合计	8,169,027,328.44	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		4.05
	其中:买断式回购融资		0.00
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期

注: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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	143
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注: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180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	46.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	14.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	24.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.02	-

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	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	510,724,233.03	6.25
	其中:政策性金融债	510,724,233.03	6.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,119,717,460.17	25.96
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,630,441,693.20	32.22
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	071503005	15中信CP005	1,500,000	149,991,346.23	1.84
2	011599168	15开滦SCP001	1,300,000	129,965,991.17	1.59
3	011599089	15山邦SCP002	1,100,000	110,002,165.14	1.35
4	150202	15国开02	1,000,000	100,256,461.20	1.23
5	150301	15进出01	1,000,000	100,043,492.97	1.23
6	011599233	15苏国信SCP003	1,000,000	100,001,014.09	1.22
7	011589001	15陕物控SCP001	800,000	80,005,201.84	0.98
8	071542003	15西部证券CP003	800,000	79,998,234.02	0.98
9	011599167	15京投控SCP001	800,000	79,983,623.60	0.98
10	041556011	15新中泰集CP001	800,000	79,970,254.38	0.98

5.6 "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	3
报告期内偏离度的最高值	0.2555%
报告期内偏离度的最低值	0.0028%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1466%

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十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

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。

5.8.2

本报告期内本基金不存在剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本报告期内基金投资的前十大证券的发行主体,除15中信CP005的发行主体中信证券于2015年1月19日收到中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施外,其他前十大证券的发行主体均未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。

5.8.4 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	67,891,736.37
4	应收申购款	16,297,942.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	84,189,678.37

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	兴业货币A	兴业货币B
报告期期初基金份额总额	2,810,219,041.22	4,657,739,246.59
报告期期间基金总申购份额	6,127,701,475.93	16,280,362,266.72
减:报告期期间基金总赎回份额	6,953,284,459.03	14,757,673,517.90
报告期期末基金份额总额	1,984,636,058.12	6,180,427,995.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年4月27日	55,000,000.00	55,000,000.00	-
2	赎回	2015年6月30日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
合计			45,000,000.00	45,000,000.00	

注:本基金收益分配为按日结转份额,本报告期本基金管理人持有的本基金份额红利再投资份额为688,767.37份,金额为688,767.37元,适用费率为0。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会准予货币市场证券投资基金募集注册的文件
2.《兴业货币市场证券投资基金基金合同》
3.《兴业货币市场证券投资基金托管协议》
4.法律意见书
5.基金管理人业务资格批件和营业执照
6.基金托管人业务资格批件和营业执照

9.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

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
2015年7月20日

兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

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:2015年7月20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2015年7月17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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业多策略混合
交易代码	000963
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月23日
报告期末基金份额总额	943,875,073.54份
投资目标	在有效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	本基金将采用"自上而下"的大类资产配置策略和"自下而上"的股票投资策略相结合的方法进行资产配置和组合风险管理。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)*1%。
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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	598,147,205.51
2.本期利润	441,031,592.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.2708
4.期末基金资产净值	1,222,336,148.69
5.期末基金份额净值	1.295

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

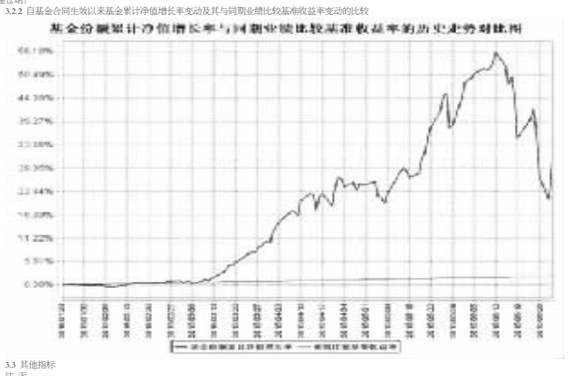
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	17.51%	2.64%	1.14%	0.01%	16.37%	2.63%

注:1.本基金基金合同于2015年1月23日生效,截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2.根据本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 其他指标

注:无。

§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		
WEIDONG WU(吴卫东)	本基金基金经理	2015年1月23日	-	20	美国籍,物理学博士,具有证券投资基金从业资格。曾在美国证券交易协会(NASD)注册,1994-1998年任德意志银行量化策略研究员(Associate Director),1998-2002年任摩尔(Moore)资产管理公司资深策略研究员,2002-2006任千禧(Millennium)基金投资经理,2007-2010任稳度(Gradient)资产管理公司投资经理,2010-2013任兴业银行资产管理部研究部负责人,2013年7月加入兴业基金管理公司。现任兴业基金管理有限公司基金经理。

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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们在二季度的前半段对股票市场较为乐观,因此在4月上旬加仓至高位。之后市场出现了大幅上涨,为了控制风险,我们不断主动地卖出或减持组合内涨幅较大的个股,但由于持续的赎回及相应的资金流出,基金的仓位并未能降低下来,这导致基金在6月中之后的市场下跌中受到了明显损伤。基金在行业配置上相对均衡,配置较多的行业有金融地产、电子、医药、消费、及汽车家电等。基金在个股层面的配置相对分散。

4.4.2 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17.51,同期业绩比较基准收益率为1.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

史无前例的救市措施已经奏效,流动性危机已经解除,市场在超跌后反弹,已经开始稳定。我们认为反弹之后市场还比较难产生趋势性的上涨,可能会面临一定的压力,市场震荡的可能性较大。首先,宏观经济和企业盈利都难有惊喜,近期的股灾及负财富效应有可能在随后几个月对实体经济产生轻微程度的负反馈,房地产市场和汽车市场可能会有一定压力。其次货币政策继续放松的空间已经不大,难以再成为推动市场的重要驱动力。另外,两融被动或主动降杠杆,新发基金的疲弱,及个人投资者入市热情的消退会使得股票市场在资金面上处于紧平衡状态。因此我们认为市场在经稳反弹之后会受较明显的压力,整体的市场机会可能比较有限,下半年权块及个股层面会显著分化。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

-

§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	1,135,840,968.39	83.59
	其中:股票	1,135,840,968.39	83.59
2	固定收益投资	69,993,000.00	5.15
	其中:债券	69,993,000.00	5.15
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	14,628,504.72	0.37
7	其他资产	78,099,691.44	1.99
8	合计	3,933,882,898.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	198,800.00	0.01
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	-	-
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	198,800.00	0.01

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	600016	民生银行	20,000	198,800.00	0.01

注:上述个股是由可转债转股获得,将按照合同约定在10个交易日内卖出。

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,887,359,964.48	65.69
5	企业短期融资券	1,339,279,000.00	46.62
6	中期票据	470,375,000.00	16.37
7	可转债	58,356,745.60	2.03
8	其他	-	-
9	合计	3,755,370,710.08	130.71

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	041560015	15永泰能源CP001	1,000,000	101,080,000.00	3.52
2	123254	15华福01	900,000	92,790,000.00	3.23
3	101574002	15沪世茂MTN001	800,000	81,104,000.00	2.82
4	123237	15民生01	800,000	80,200,000.00	2.79
5	124916	14新开元	700,000	72,800,000.00	2.53
J	金融业	222,683,102.91	18.22
K	房地产业	73,098,115.65	5.98
L	租赁和商务服务业	17,372,565.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,135,840,968.39	92.92

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	600885	宏发股份	1,902,160	59,613,694.40	4.88
2	002454	松芝股份	2,675,615	58,060,845.50	4.75
3	000963	华东医药	811,329	50,708,062.50	4.15
4	601601	中国太保	1,492,699	45,049,655.82	3.69
5	601318	中国平安	534,148	43,768,087.12	3.58
6	000002	万 科A	2,879,624	41,812,140.48	3.42
7	601628	中国人寿	1,309,158	41,002,828.56	3.35
8	601877	正泰电器	1,248,445	39,238,626.35	3.21
9	002074	东源电器	1,365,885	33,887,606.85	2.77
10	600741	华域汽车	1,545,153	32,989,016.55	2.70

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	69,993,000.00	5.73
	其中:政策性金融债	69,993,000.00	5.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	69,993,000.00	5.73

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	110221	11国开21	700,000	69,993,000.00	5.73

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

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究,结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的股值水平、基差水平、流动性等因素的分析,选择合适的期货合约构建相应的头寸,以调整投资组合的风险暴露,降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金的建仓或变现效率。

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

注: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	2,088,022.09
2	应收证券清算款	71,195,253.07
3	应收股利	-
4	应收利息	791,241.45
5	应收申购款	14,167,144.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,241,661.28

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000963	华东医药	50,708,062.50	4.15	重大事项停牌
2	601877	正泰电器	39,238,626.35	3.21	重大事项停牌

注:除上述股票外本基金本报告期末其他前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,293,361,596.76
报告期期间基金总申购份额	692,926,876.14
减:报告期期间基金总赎回份额	2,042,413,399.36
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	943,875,073.54

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.06

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.06	10,000,000.00	1.06	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	1.06	10,000,000.00	1.06	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

无

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会准予兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件
2.《兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
3.《兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
4.法律意见书
5.基金管理人业务资格批件和营业执照
6.基金托管人业务资格批件和营业执照

10.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处

10.3 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
2015年7月20日

兴业年年利定期开放债券型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

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:2015年7月20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2015年7月17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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业年年利定开债券
交易代码	001019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月12日
报告期末基金份额总额	2,780,169,957.25份
投资目标