兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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:2016年1月22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2016年1月20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,投资者在做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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业稳固收益两年理财债券
交易代码	001369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月10日
报告期末基金份额总额	1,848,424,447.64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期限匹配,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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	13,122,691.10
2.本期利润	13,122,691.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0071
4.期末基金资产净值	1,877,303,203.00
5.期末基金份额净值	1.016

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。

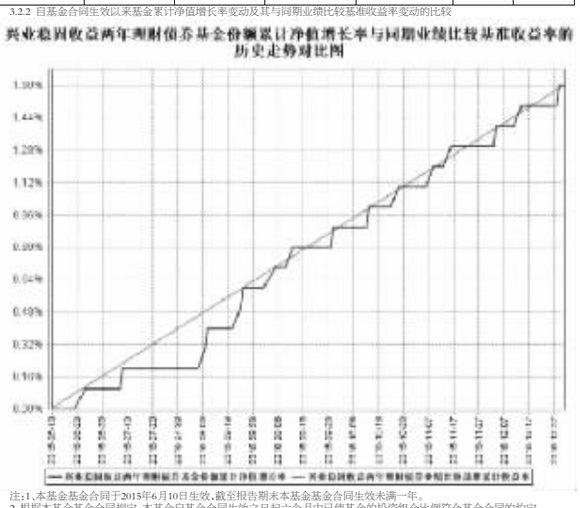
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.69%	0.03%	0.71%	0.01%	-0.02%	0.02%

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2015年6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		
徐莹	本基金的基金经理,套利与量化投资部综合套利总监	2015年6月10日	-	7	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资,2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司,2014年3月13日至2015年7月24日担任兴业定开债券基金基金经理,2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理,2015年7月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金基金经理,2015年7月23日起担任兴业添天盈货币市场基金基金经理,2015年11月2日起担任兴业鑫天盈货币市场基金基金经理,2015年12月28日起担任兴业丰利债券型证券投资基金基金经理。
杨逸君	本基金的基金经理	2015年11月9日	-	5	杨逸君,硕士学位,金融风险管理师(FRM)。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,2015年6月起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金和兴业添天盈货币市场基金的基金经理助理。2015年11月9日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金和兴业添天盈货币市场基金的基金经理。

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年第四季度,经济弱企稳,PMI位于历史低位震荡,房地产成交和价格继续稳定于高位,但仍处于去库存阶段,周期类行业需求萎靡,整体下行压力较大。在总需求偏弱的背景下,企业投资意愿受制约,以原油价格为代表的大宗商品价格、金属价格震荡走低,工业品价格继续下跌。全球方面,美元加息靴子落地,新兴国家经济增长速度不断趋缓,全球其他经济体走弱。整体而言,国内稳增长压力仍然较大,11月初打新重启对债市又造成一定冲击,使得债券市场收益率进一步走低。

报告期内,考虑经济下行压力大,资源类企业信用风险激增,组合严格把握债券的信用风险,适当降低风险偏好,同时基于债券绝对收益率水平、信用利差状况、资金面以及债券供需等多方面综合考虑,并结合本基金的持有配置策略,组合继续维持较为稳健的操作策略。

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0.69%,同期业绩比较基准收益率为0.71%。

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2016年一个季度,在全球供需不平衡、美元强势背景下,全球经济需求偏弱,大宗商品持续低迷,工业通缩压力将持续,叠加春节前资金季节性回升压力较大,货币政策有进一步保持宽松的必要。债市绝对收益率处于历史低位。春节前,货币市场资金需求明显扩张,央行的资金投放力度也将加大,从而导致货币宽松预期回暖。在股市、汇市继续大幅波动情况下,风险偏好或进一步下行,债市需求或维持。我们对2016年第一季度债券市场仍持保守态度,我们将密切跟踪经济、政策、环境的变化,及时调整组合的久期和信用结构,在信用事件密集暴露以及后续信用风险仍可能继续发酵的背景下,继续采取较为稳健的操作策略。

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	1,715,114,040.52	91.29
	其中:债券	1,438,702,498.11	76.58
	资产支持证券	276,411,542.41	14.71
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	138,528,709.29	7.37
8	其他资产	25,037,565.15	1.33
9	合计	1,878,680,314.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	486,145,401.65	25.90
5	企业短期融资券	173,266,295.02	9.23
6	中期票据	779,290,801.44	41.51
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,438,702,498.11	76.64

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	1182218	11伊泰MTN1	1,700,000	173,131,539.55	9.22
2	0980147	09中航工债浮	1,700,000	172,434,827.57	9.19
3	1182227	11开滦股MTN1	1,400,000	142,666,468.81	7.60
4	1182382	11经投投MTN1	1,300,000	133,089,080.68	7.09
5	0980132	09国网债01	1,200,000	121,917,716.49	6.49

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	1589079	15京元1A2	1,400,000	90,410,632.13	4.82
2	1589067	15兴银2A2	1,410,000	84,647,627.38	4.51
3	1589086	15德宝天元1A2	350,000	34,044,049.40	1.81
4	1589080	15京元1B	320,000	31,950,520.29	1.70
5	1589087	15德宝天元1B	204,000	20,185,997.95	1.08
6	1589063	15兴银1A2	300,000	9,247,317.32	0.49
7	1589076	15威元1B	303,000	5,925,397.94	0.32

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:报本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期没有投资股票。

5.10.3 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	应收股利	-
4	应收利息	25,037,565.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,037,565.15

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: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	1,848,424,447.64
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	1,848,424,447.64

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.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

2.《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金基金合同》

3.《兴业稳固收益两年理财债券型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

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人住所

8.3 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
2016年1月22日

兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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:2016年1月22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2016年1月20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,投资者在做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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业稳固收益一年理财债券
交易代码	001368
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月10日
报告期末基金份额总额	1,245,126,262.46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期限匹配,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一年期定期存款利率(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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	7,999,884.42
2.本期利润	7,999,884.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064
4.期末基金资产净值	1,260,049,856.45
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。

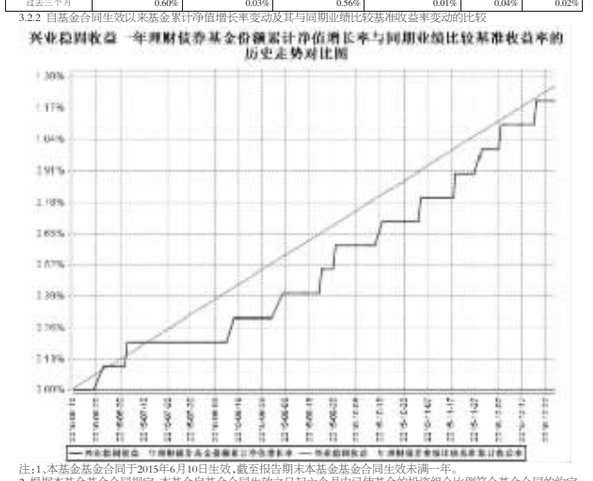
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.60%	0.03%	0.56%	0.01%	0.04%	0.02%

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2015年6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		
徐莹	本基金的基金经理,套利与量化投资部综合套利总监	2015年6月10日	-	7	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资,2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司,2014年3月13日至2015年7月24日担任兴业定开债券基金基金经理,2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理,2015年7月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金基金经理,2015年7月23日起担任兴业添天盈货币市场基金基金经理,2015年11月2日起担任兴业鑫天盈货币市场基金基金经理,2015年12月28日起担任兴业丰利债券型证券投资基金基金经理。
杨逸君	本基金的基金经理	2015年11月9日	-	5	杨逸君,硕士学位,金融风险管理师(FRM)。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,2015年6月起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金和兴业添天盈货币市场基金的基金经理助理。2015年11月9日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金、兴业添利债券型证券投资基金和兴业添天盈货币市场基金的基金经理。

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年第四季度,经济弱企稳,PMI位于历史低位震荡,房地产成交和价格继续稳定于高位,但仍处于去库存阶段,周期类行业需求萎靡,整体下行压力较大。在总需求偏弱的背景下,企业投资意愿受制约,以原油价格为代表的大宗商品价格、金属价格震荡走低,工业品价格继续下跌。全球方面,美元加息靴子落地,新兴国家经济增长速度不断趋缓,全球其他经济体走弱。整体而言,国内稳增长压力仍然较大,11月初打新重启对债市又造成一定冲击,使得债券市场收益率进一步走低。

报告期内,考虑经济下行压力大,资源类企业信用风险激增,组合严格把握债券的信用风险,适当降低风险偏好,同时基于债券绝对收益率水平、信用利差状况、资金面以及债券供需等多方面综合考虑,并结合本基金的持有配置策略,组合继续维持较为稳健的操作策略。

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0.60%,同期业绩比较基准收益率为0.56%。

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2016年一个季度,在全球供需不平衡、美元强势背景下,全球经济需求偏弱,大宗商品持续低迷,工业通缩压力将持续,叠加春节前资金季节性回升压力较大,货币政策有进一步保持宽松的必要。债市绝对收益率处于历史低位。春节前,货币市场资金需求明显扩张,央行的资金投放力度也将加大,从而导致货币宽松预期回暖。在股市、汇市继续大幅波动情况下,风险偏好或进一步下行,债市需求或维持。我们对2016年第一季度债券市场仍持保守态度,我们将密切跟踪经济、政策、环境的变化,及时调整组合的久期和信用结构,在信用事件密集暴露以及后续信用风险仍可能继续发酵的背景下,继续采取较为稳健的操作策略。

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	1,031,080,848.98	81.77
	其中:债券	820,087,665.79	65.04
	资产支持证券	210,993,183.19	16.73
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	215,756,476.48	17.11
8	其他资产	14,116,125.72	1.12
9	合计	1,260,953,451.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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

注: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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	152,608,753.26	12.11
5	企业短期融资券	642,385,637.59	50.98
6	中期票据	25,093,274.94	1.99
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	820,087,665.79	65.08

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	011584006	15宁沪高SCP006	1,100,000	110,004,754.71	8.73
2	011599358	15短投集SCP001	1,000,000	99,992,137.39	7.94
3	011509006	15国电集SCP006	1,000,000	99,956,765.69	7.93
4	011569006	15沪电力SCP006	1,000,000	99,937,933.27	7.93
5	011599648	15鲁商SCP008	620,000	62,040,866.30	4.92

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	1589096	15盛世1A	1,300,000	106,411,799.84	8.45
2	1589326	15恒金3A1	400,000	40,010,833.03	3.18
3	1589063	15兴银1A2	1,200,000	36,989,211.92	2.94
4	1589083	15渤银1B	276,000	27,581,338.40	2.19

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:报本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期没有投资股票。

5.10.3 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	应收股利	-
4	应收利息	14,116,125.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,116,125.72

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: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	1,245,126,262.46
报告期期间基金总申购份额	0.00
减:报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00
报告期期末基金份额总额	1,245,126,262.46

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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金募集注册的文件

2.《兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金合同》

3.《兴业稳固收益一年理财债券型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

8.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人住所

8.3 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
2016年1月22日

兴业添天盈货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

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
报告送出日期:2016年1月22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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月20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,投资者在做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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业添天盈货币	
交易代码	001624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年7月23日	
报告期末基金份额总额	10,025,303,786.93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	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	17,539.90份	10,025,286,247.03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10月1日 - 2015年12月31日)	
	兴业添天盈货币A	兴业添天盈货币B
1. 本期已实现收益	109.98	25,066,695.02
2.本期利润	109.98	25,066,695.02
3.期末基金资产净值	17,539.90	10,025,286,247.03

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

兴业添天盈货币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	0.5515%	0.0028%	0.3403%	0.0000%	0.2112%	0.0028%

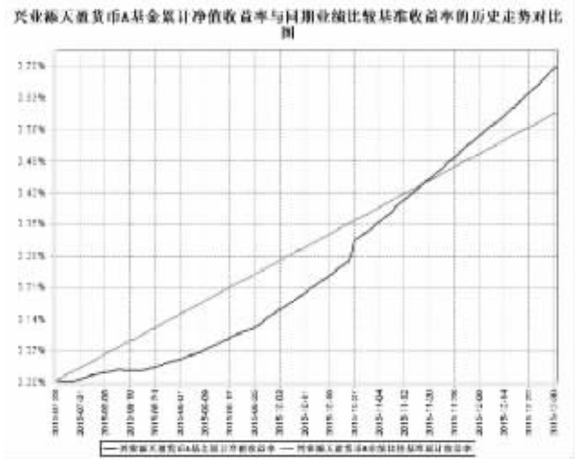
注:本基金收益分配为按日结转份额。

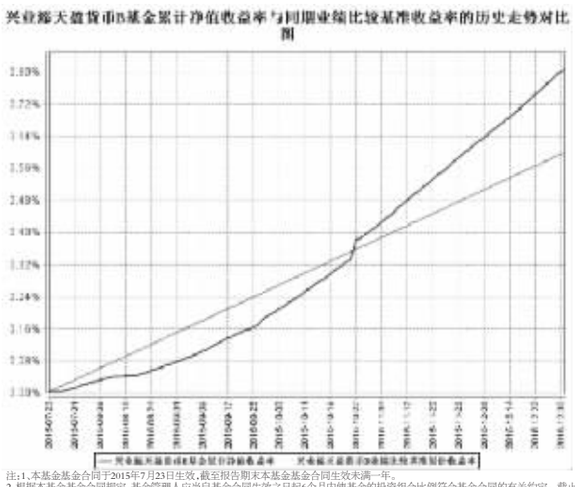
兴业添天盈货币B

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	0.6126%	0.0028%	0.3403%	0.0000%	0.2723%	0.0028%

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:1、本基金基金合同于2015年7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。

§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		
徐莹	本基金基金经理,套利与量化投资部综合套利总监	2015年7月23日	-	7	中国籍,硕士学位,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资,2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司,2014年3月13日至2015年7月24日担任兴业定开债券基金基金经理,2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理,2015年6月10日起担任兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理,2015年7月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金基金经理,2015年7月23日起担任兴业添