兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金

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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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	兴业聚优灵活配置混合
交易代码	001321
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月21日
报告期末基金份额总额	1,615,649,416.08份
投资目标	以风险管理为基础,通过积极主动的资产配置和丰富有效的投资策略,力争为基金份额持有人获得超越业绩基准的绝对回报。
投资策略	本基金旨在追求绝对回报,注重风险控制,通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略控制下行风险,因势利导运用多样化的投资策略实现基金资产稳定增值。
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	13,708,521.21
2.本期利润	18,398,469.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0144
4.期末基金资产净值	1,720,097,942.16
5.期末基金份额净值	1.065

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。

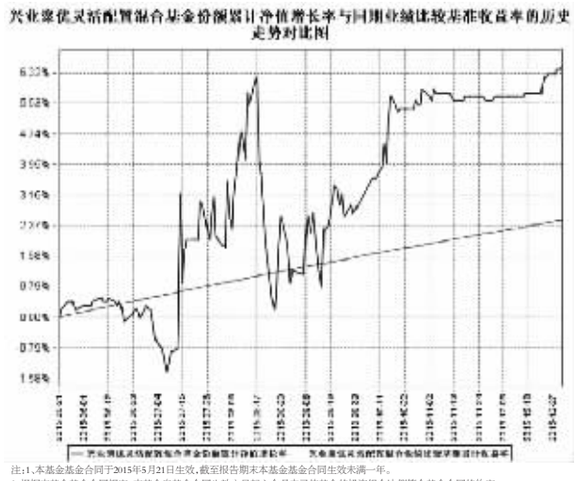
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	3.60%	0.23%	0.95%	0.01%	2.65%	0.22%

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5月21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		
周鸣	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2015年5月21日	-	14	中国籍,工商管理硕士,具有证券投资基金从业资格。先后任职于天相投资顾问有限公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司从事基金投资、企业年金投资等。2009年加入申万菱信基金管理有限公司担任固定收益部总经理。2009年6月至2013年7月担任申万菱信益宝债券基金基金经理,2009年6月至2013年7月担任申万菱信益宝债券基金基金经理,2011年12月至2013年7月担任申万菱信可转债债券基金基金经理。2013年8月加入兴业基金管理有限公司担固定收益投资总监。现任兴业基金管理有限公司固定收益投资总监,基金经理。2014年3月13日起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5月21日起担任兴业聚优灵活配置混合基金基金经理,2015年5月29日起担任兴业收益增强债券基金基金经理。
碧博	本基金的基金经理	2015年5月21日	-	11	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。新西兰梅西大学金融硕士。2003年7月至2006年4月,在新西兰ANYING国际金融有限公司担任投资策略师;2007年1月至2008年5月,在新西兰FORSIGHT金融研究有限公司担任策略分析师;2008年5月至2010年8月,在长城证券有限责任公司担任策略研究员;2010年8月至2014年12月就职于中欧基金管理有限公司,其中2010年8月至2012年1月担任定量、策略研究员,2012年1月至2013年8月担任中欧新趋势股票型证券投资基金、中欧新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中欧稳健收益债券型证券投资基金、中欧信用增利分级债券型证券投资基金、中欧货币市场基金的基金经理助理,2013年8月至2014年12月担任中欧稳健收益债券型证券投资基金基金经理。2014年12月加入兴业基金管理有限公司,2015年5月14日起担任兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年5月21日起担任兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月8日起担任兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年7月24日担任兴业定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类份额净值增长率为4.62%,同期业绩比较基准收益率为3.27%,本基金C类份额净值增长率为4.43%,同期业绩比较基准收益率为3.27%。

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,经济仍在探底过程中,通胀保持低位且钝化,货币政策延续宽松,基本面和政策面对债券市场依然形成较强的支撑。但债券目前估值水平已逼近历史低位,市场对任何负面影响将高度敏感,多空因素交织,市场的波动性将显著增强。2016年市场将面临诸多风险挑战,汇率问题、美国加息节奏、供给放量、信用风险增多、大宗波动加剧、竞争性资产价格上涨等多种因素都可能对债券市场造成压力,不过由于基本面强力支撑以及债券旺盛的配置需求,收益率一旦调整也将是买入的时机,2016年交易性的机会或将明显增多。目前市场给予可转债的估值定价偏高,这种偏高的状态随着供给的释放会有所修复,需要持机进行配置。财政扩张和供给侧改革也会导致部分产业债出现投资机会。

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	6,929,857.06	0.40
	其中:股票	6,929,857.06	0.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,104,000.00	4.65
	其中:债券	80,104,000.00	4.65
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	660,201,510.30	38.31
	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	970,717,219.32	56.33
8	其他资产	5,285,907.59	0.31
9	合计	1,723,238,494.27	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	3,007,624.03	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,002,328.20	0.06
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	2,588,208.18	0.15
J	金融业	-	-
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	109,392.21	0.01
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	6,929,857.06	0.40

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	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.07
2	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.05
3	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.05
4	603398	邦宝益智	6,343	586,220.06	0.03
5	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.03
6	603936	博敏电子	7,448	381,933.44	0.02
7	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.02
8	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.02
9	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.02
10	002779	中坚科技	3,078	240,699.60	0.01

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	80,104,000.00	4.66
	其中:政策性金融债	80,104,000.00	4.66
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	80,104,000.00	4.66

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	150215	15国开15	800,000	80,104,000.00	4.66

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:本基金本报告期末投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择、谨慎进行投资,旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

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

本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

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:本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:报告期内,本基金未参与国债期货投资。

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	260,914.20
2	应收证券清算款	2,984,298.64
3	应收股利	-
4	应收利息	2,030,754.39
5	应收申购款	9,940.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,285,907.59

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在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额	99,054,122.93
报告期间基金总申购份额	2,320,084,345.69
减:报告期间基金总赎回份额	803,489,052.54
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	1,615,649,416.08

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聚优灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件

2.《兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3.《兴业聚优灵活配置混合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、基金托管人处

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

兴业收益增强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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商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	兴业收益增强债券	
交易代码	001257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月29日	
报告期末基金份额总额	731,204,231.62份	
投资目标	本基金在保持资产流动性以及严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金将密切关注股票、债券以及货币市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济基本面、政策面、流动性、估值与供求等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,确定各类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。	
业绩比较基准	本基金采用"中债综合全价指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%"作为投资业绩比较基准。	
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,其风险收益预期高于货币市场基金,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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	兴业收益增强债券A	兴业收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	001257	001258
报告期末下属分级基金的份额总额	413,779,209.61份	317,425,022.01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)	
	兴业收益增强债券A	兴业收益增强债券C
1.本期已实现收益	14,303,097.07	11,126,472.87
2.本期利润	21,831,249.60	17,218,512.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0465	0.0451
4.期末基金资产净值	440,106,132.37	336,609,122.25
5.期末基金份额净值	1.064	1.060

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

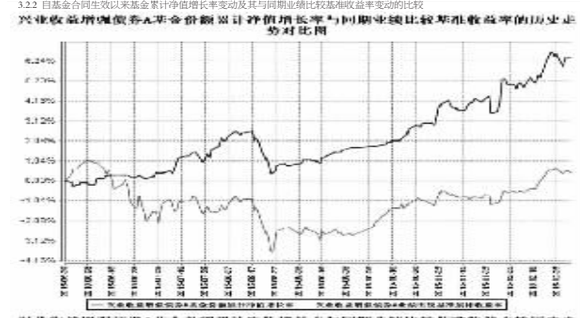
兴业收益增强债券A

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	4.62%	0.29%	3.27%	0.17%	1.35%	0.12%

兴业收益增强债券C

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	4.43%	0.30%	3.27%	0.17%	1.16%	0.13%

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5月29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		
丁逸	本基金的基金经理	2015年5月29日	-	5	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2005年7月至2008年2月,在北京顺泽隆投资咨询有限公司担任研究员;2008年3月至2010年10月,在新华信国际信息咨询(北京)有限公司担任企业信用研究高级咨询顾问;2010年10月至2012年8月,在光大证券研究所担任信用及转债研究员;2012年8月至2015年2月就职于浦银安盛基金管理有限公司,其中2012年8月至2015年2月担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金的基金经理助理,2012年9月至2015年2月担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,2013年5月至2015年2月担任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理,2013年6月至2015年2月担任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2015年2月加入兴业基金管理有限公司,2015年5月29日起任兴业收益增强债券型证券投资基金的基金经理,2015年7月6日起任兴业年年利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年9月21日起任兴业货币市场证券投资基金基金经理。
周鸣	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2015年5月29日	-	14	中国籍,工商管理硕士,具有证券投资基金从业资格。先后任职于天相投资顾问有限公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司从事基金投资、企业年金投资等。2009年加入申万菱信基金管理有限公司担任固定收益部总经理。2009年6月至2013年7月担任申万菱信益宝债券基金基金经理,2009年6月至2013年7月担任申万菱信益宝债券基金基金经理,2011年12月至2013年7月担任申万菱信可转债债券基金基金经理。2013年8月加入兴业基金管理有限公司担固定收益投资总监。现任兴业基金管理有限公司固定收益投资总监,基金经理。2014年3月13日起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5月21日起担任兴业聚优灵活配置混合基金基金经理,2015年5月29日起担任兴业收益增强债券基金基金经理。

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 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金A类份额净值增长率为4.62%,同期业绩比较基准收益率为3.27%,本基金C类份额净值增长率为4.43%,同期业绩比较基准收益率为3.27%。

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,经济仍在探底过程中,通胀保持低位且钝化,货币政策延续宽松,基本面和政策面对债券市场依然形成较强的支撑。但债券目前估值水平已逼近历史低位,市场对任何负面影响将高度敏感,多空因素交织,市场的波动性将显著增强。2016年市场将面临诸多风险挑战,汇率问题、美国加息节奏、供给放量、信用风险增多、大宗波动加剧、竞争性资产价格上涨等多种因素都可能对债券市场造成压力,不过由于基本面强力支撑以及债券旺盛的配置需求,收益率一旦调整也将是买入的时机,2016年交易性的机会或将明显增多。目前市场给予可转债的估值定价偏高,这种偏高的状态随着供给的释放会有所修复,需要持机进行配置。财政扩张和供给侧改革也会导致部分产业债出现投资机会。

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	145,388,224.78	13.79
	其中:股票	145,388,224.78	13.79
2	固定收益投资	656,743,788.90	62.29
	其中:债券	656,743,788.90	62.29
	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	132,825,353.27	12.60
7	其他资产	119,365,178.55	11.32
8	合计	1,054,322,545.50	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	80,667,446.78	10.39
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	42,325,278.00	5.45
K	房地产业	22,395,500.00	2.88
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	145,388,224.78	18.72

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	000651	格力电器	1,070,000	23,914,500.00	3.08
2	002142	宁波银行	1,470,000	22,799,700.00	2.94
3	002146	荣盛发展	2,350,000	22,395,500.00	2.88
4	000333	美的集团	600,000	19,692,000.00	2.54
5	601009	南京银行	1,103,140	19,525,578.00	2.51
6	000625	长安汽车	933,074	15,834,265.78	2.04
7	601633	长城汽车	880,000	10,595,200.00	1.36
8	002658	雪迪龙	204,900	5,571,231.00	0.72
9	600066	宇通客车	225,000	5,060,250.00	0.65

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	50,215,000.00	6.47
	其中:政策性金融债	50,215,000.00	6.47
4	企业债券	510,925,393.10	65.78
5	企业短期融资券	60,186,000.00	7.75
6	中期票据	31,830,000.00	4.10
7	可转债	3,587,395.80	0.46
8	其他	-	-
9	合计	656,743,788.90	84.55

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	1580122	15马花山债	600,000	64,356,000.00	8.29
2	150206	15国开06	500,000	50,215,000.00	6.47
3	1180184	11通化债	450,000	49,855,500.00	6.42
4	1480447	14福鼎债	400,000	42,844,000.00	5.52
5	1080141	10川发展债01	400,000	41,488,000.00	5.34

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:根据本基金合同,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

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	434,967.05
2	应收证券清算款	103,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	13,306,932.47
5	应收申购款	2,623,279.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,365,178.55

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

报告期初基金份额总额	539,317,204.42
报告期间基金总申购份额	13,166,423.33
减:报告期间基金总赎回份额	138,704,418.14
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	413,779,209.61

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收益增强债券型证券投资基金募集注册的文件

2.《兴业收益增强债券型证券投资基金基金合同》

3.《兴业收益增强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、基金托管人处

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

兴业添利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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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	兴业添利债券
交易代码	001299
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	9,993,975,581.70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	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 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	140,561,986.43
2.本期利润	310,727,450.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0328
4.期末基金资产净值	10,487,708,936.46
5.期末基金份额净值	1.049

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