兴业货币市场证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:2019年07月19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2019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2019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	
基金主代码	000721	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年08月06日	
报告期末基金份额总额	5,201,974,035.40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	404,867,150.37份	4,797,106,885.03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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)	
	兴业货币A	兴业货币B
1.本期已实现收益	2,234,026.28	47,930,384.82
2.本期利润	2,234,026.28	47,930,384.82
3.期末基金资产净值	404,867,150.37	4,797,106,885.03

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,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净值表现

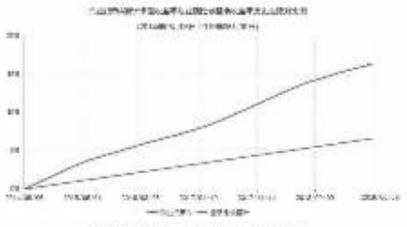
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5265%	0.0022%	0.3366%	0.0000%	0.1899%	0.0022%

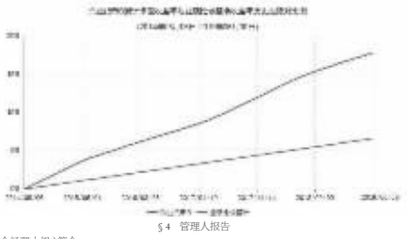
兴业货币B净值表现

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	0.5868%	0.0022%	0.3366%	0.0000%	0.2502%	0.0022%

注:1、本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率(税后)。
2、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





§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		
刘禹含	基金经理	2017-04-21	-	6年	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2013年7月至2015年10月在万家基金管理有限公司担任债券交易员,主要从事债券交易工作。2015年11月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。
王卓然	基金经理	2019-02-21	-	4年	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2015年6月至2017年4月在成都农村商业银行金融市场事业部担任债券交易员,投资顾问;2017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、本基金的基金经理刘禹含女士因个人原因(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刘禹含女士于2018年11月28日开始休假并进行公告。刘禹含女士休假期间,由共同管理本基金的基金经理继续履行基金管理职责。刘禹含女士已结束休假,于2019年4月8日起恢复履行基金经理职责。

4.2 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

2019年二季度货币政策继续保持稳健顺应了逆周期调节的要求,市场流动性较为充裕。五月底包商事件打破同业刚兑,银行信用分化迹象显现,流动性分层蔓延。兴业货币把握了事件性冲击收益率上行时间点积极配置各类资产,提高利率债和信用债仓位,合理拉长组合久期并提高杠杆率增强组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业货币A基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.5265%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%;截至报告期末兴业货币B基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为0.5868%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

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	固定收益投资	3,543,074,018.32	57.59
	其中:债券	3,543,074,018.32	57.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,829,313,023.97	29.73
	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	745,644,781.11	12.12
4	其他资产	34,608,492.39	0.56
5	合计	6,152,640,315.79	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	1.58
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	947,598,286.19	18.22
	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

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	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	17

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

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120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	47.39	18.22
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	39.17	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	9.96	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	12.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		117.61	18.22

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

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	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	320,678,311.68	6.16
	其中:政策性金融债	320,678,311.68	6.16
4	企业债券	775,657,467.36	14.91
5	企业短期融资券	390,429,183.54	7.51
6	中期票据	141,023,128.23	2.71
7	同业存单	1,915,285,927.51	36.82
8	其他	-	-
9	合计	3,543,074,018.32	68.11
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	111921211	19渤海银行CD211	5,500,000	546,254,386.68	10.50
2	111921204	19渤海银行CD204	2,000,000	198,654,624.28	3.82
3	111994557	19成都农商银行CD016	2,000,000	198,569,822.82	3.82
4	0980135	09铁道01	1,200,000	121,267,107.64	2.33
5	071900046	19渤海证券CP006	1,200,000	120,021,001.30	2.31
6	111889285	18南京银行CD120	1,200,000	118,633,102.15	2.28
7	140441	14农发41	1,100,000	110,152,978.04	2.12
8	143416	17中信G3	1,000,000	101,364,770.90	1.95
9	041800366	18辽金CP006	1,000,000	100,573,994.78	1.93
10	136510	16华电01	1,000,000	100,012,730.78	1.92

5.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0453%
报告期内偏离度的最低值	-0.0128%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0106%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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。

5.9.2 2018年11月19日,中信银行被银保监会处罚2280万元,违规事由包括:理财资金违规缴纳土地款;自有资金融资违规缴纳土地款;为非保本理财产品提供保本承诺;本行信贷资金为理财产品提供融资;收益权转让业务违规提供信用担保;项目投资审核严重缺位。

2018年12月7日,渤海银行因5项违法违规事实受到中国银保监会处罚,被罚2530万元。违法违规事实包括:内控管理严重违反审慎经营规则;理财及自营投资资金违规用于缴交土地款;理财业务风险隔离不到位;为非保本理财产品提供保本承诺;同业投资他行非保本理财产品审查不到位。

以上主体发行的证券经信用研究员出具相关意见,并进行债券入库审批流程,基金管理人经过研究判断,按照相关投资决策流程投资了该债券。

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除中信银行、渤海银行外未发现有被监管部门立案调查的情形,未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,225.03
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	34,038,047.29
4	应收申购款	530,220.07
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	34,608,492.39

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	兴业货币A	兴业货币B
报告期期初基金份额总额	445,275,625.77	6,645,261,744.14
报告期期间基金总申购份额	55,782,516.47	14,396,770,612.21
报告期期间基金总赎回份额	96,190,991.87	16,244,925,471.32
报告期期末基金份额总额	404,867,150.37	4,797,106,885.03

注:申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额;赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

§7 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	20190626-20190630	0.00	1,206,036,086.12	0.00	1,206,036,086.12	23.18%
	2	20190401	1,498,086,303.30	6,408,642.56	979,000,000.00	525,494,945.86	10.10%
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。						

注: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

无。

§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。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司
2019年07月19日

兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月19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2019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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴业聚宝灵活配置混合
基金主代码	002330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年02月03日
报告期末基金份额总额	37,821,844.50份
投资目标	本基金通过精选具有较高成长性和投资价值的金融工具,在充分控制投资风险的基础下,力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过预测资本市场资金环境、宏观经济的发展趋势,使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化投资组合,谋求超额收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%
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	交通银行股份有限公司

§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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	1,726,359.00
2.本期利润	-205,435.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0048
4.期末基金资产净值	44,030,136.06
5.期末基金份额净值	1.164

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。

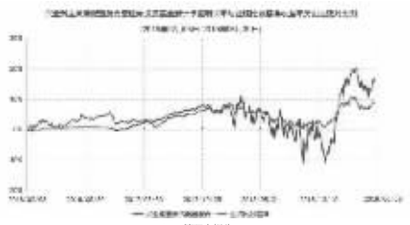
3.2 基金净值表现

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	0.00%	0.82%	-0.38%	0.44%	0.38%	0.38%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率*70%+沪深300指数收益率*30%。

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		
冯俎	权益投资部负责人、基金经理	2017-07-26	-	15年	中国籍,加拿大多伦多大学MBA及中国人民大学经济学硕士,特许金融分析师(CFA),具有证券投资基金从业资格。2002年7月至2003年8月在第一创业证券有限公司证券投资部担任研究员,2005年11月至2011年3月在汇丰晋信基金管理有限公司投资部担任研究员、高级研究员、基金经理,期间2009年7月至2010年12月担任汇丰晋信2016生命周期开放式证券投资基金基金经理,2010年1月至2011年3月担任汇丰晋信2026生命周期证券投资基金基金经理,2011年3月至2014年6月在中国国际金融有限公司资产管理部担任投资经理(执行总经理级别),管理中金安心回报、中金股票策略、中金股票精选集合资产管理计划,2014年6月至2015年1月在汇丰晋信基金管理有限公司担任QFII投资咨询部总监,负责四只QFII基金的A股投顾工作,2015年2月加入兴业基金管理有限公司,现任权益投资部负责人、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,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

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

由于前期判断基本面压力及市场风险都比较大,本基金4月上中旬降低仓位,在4月下旬至5月上旬的市场下跌中回撤相对可控,5月回补仓位、布局了之后的反弹。总体来看,二季度的择时较好。基金主要投资了医药、电力设备新能源、TMT等板块,也有少量的金融地产。个股层面持仓相对分散,总体来看个股层面有一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业聚宝灵活配置混合基金份额净值为1.164元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.00%,同期业绩比较基准收益率为-0.38%。

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	29,990,975.59	67.90
	其中:股票	29,990,975.59	67.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,695,620.00	8.37
	其中:债券	3,695,620.00	8.37
	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	9,000,000.00	20.38
	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	1,321,764.94	2.99
8	其他资产	157,836.98	0.36
9	合计	44,166,197.51	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	17,142,008.48	38.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	991,395.00	2.25
F	批发和零售业	183,929.20	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	91,476.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,902,239.00	8.86
J	金融业	1,198,278.95	2.72
K	房地产业	838,032.00	1.90
L	租赁和商务服务业	837,957.16	1.90
M	科学研究和技术服务业	422,931.00	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	1,599,738.00	3.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,420,274.80	3.23
R	文化、体育和娱乐业	1,362,716.00	3.09
S	综合	-	-
	合计	29,990,975.59	68.11

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	000538	云南白药	40,411	3,371,085.62	7.66
2	600406	国电南瑞	139,400	2,598,416.00	5.90
3	600566	济川药业	61,200	1,842,732.00	4.19
4	002262	恩华药业	170,700	1,841,853.00	4.18
5	002050	三花智控	156,025	1,646,063.75	3.74
6	601877	正泰电器	69,600	1,607,064.00	3.65
7	600054	黄山旅游	172,200	1,599,738.00	3.63
8	601233	桐昆股份	96,194	1,491,968.94	3.39
9	002044	美年健康	114,170	1,420,274.80	3.23
10	002739	万达电影	73,900	1,362,716.00	3.09

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	2,595,840.00	5.90
	其中:政策性金融债	2,595,840.00	5.90
4	企业债券	1,099,780.00	2.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,695,620.00	8.39

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	190301	19进出01	26,000	2,595,840.00	5.90
2	112257	15荣盛02	11,000	1,099,780.00	2.50

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

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

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	72,959.58
5	应收申购款	1,410.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	157,836.98

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

报告期期初基金份额总额	47,566,249.80
报告期间基金总申购份额	1,126,042.18
减:报告期期间基金总赎回份额	10,870,447.48
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	37,821,844.50

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	20190401-20190630	33,460,803.06	-	-	33,460,803.06	88.47%
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。						

注: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

无。

§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聚宝灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
(二)《兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(三)《兴业聚宝灵活配置混合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
2019年07月19日

兴业福益债券型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月19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2019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2019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	946,988,037.48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(2019年04月01日 - 2019年06月30日)
1.本期已实现收益	9,269,277.78
2.本期利润	6,870,378.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075
4.期末基金资产净值	1,018,127,994.75
5.期末基金份额净值	1.075

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	0.84%	0.04%	-0.24%	0.06%	1.08%	-0.02%

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