

# 兴全磐稳增利债券型证券投资基金

## 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金简称         | 兴全磐稳增利债券           |
| 场内简称         | —                  |
| 基金主代码        | 340009             |
| 前端交易代码       | —                  |
| 后端交易代码       | —                  |
| 基金运作方式       | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日      | 2009 年 7 月 23 日    |
| 基金管理人        | 兴业全球基金管理有限公司       |
| 基金托管人        | 交通银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额   | 4,210,231,196.30 份 |
| 基金合同存续期      | 不定期                |
| 基金份额上市的证券交易所 | —                  |
| 上市日期         | —                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在保证基金资产良好流动性的基础上，通过严格风险控制下的债券及其他证券产品投资，追求低风险下的稳定收益，并争取在基金资产保值的基础上，积极利用各种稳健的投资工具力争资产的持续增值。         |
| 投资策略   | 在严格的风险控制和确保基金资产流动性的前提下，在系统性分析研究的基础上，通过对债券类属配置和目标久期的适时调整，适时合理地利用现有的企业债券等投资工具，配合套利策略的积极运用，追求低风险下的稳健收益。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数×95%+同业存款利率×5%   |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型证券投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型、混合型以及可转债证券投资基金，高于货币市场基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |    | 基金管理人        | 基金托管人      |
|---------|----|--------------|------------|
| 名称      |    | 兴业全球基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 冯晓莲          | 汤嵩彦        |

|        |      |                          |                     |
|--------|------|--------------------------|---------------------|
|        | 联系电话 | 021-20398888             | 95559               |
|        | 电子邮箱 | fengxl@xyfunds.com.cn    | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话 |      | 4006780099, 021-38824536 | 95559               |
| 传真     |      | 021-20398858             | 021-62701216        |

## 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.xyfunds.com.cn">http://www.xyfunds.com.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所  |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 182,675,381.91                        |
| 本期利润          | 123,287,140.25                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0261                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.16%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1183                                |
| 期末基金资产净值      | 5,729,618,943.35                      |
| 期末基金份额净值      | 1.3609                                |

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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。

3、上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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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 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             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 0.85%        | 0.03%               | 0.69%              | 0.05%                 | 0.16%  | -0.02% |
| 过去三个月          | 0.58%        | 0.07%               | 0.35%              | 0.06%                 | 0.23%  | 0.01%  |
| 过去六个月          | 2.16%        | 0.07%               | 1.56%              | 0.06%                 | 0.60%  | 0.01%  |
| 过去一年           | 8.23%        | 0.08%               | 6.04%              | 0.06%                 | 2.19%  | 0.02%  |
| 过去三年           | 52.46%       | 0.35%               | 16.67%             | 0.10%                 | 35.79% | 0.25%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 62.74%       | 0.26%               | 31.66%             | 0.08%                 | 31.08% | 0.18%  |

注：本基金业绩比较基准为中证全债指数×95%+同业存款利率×5%，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

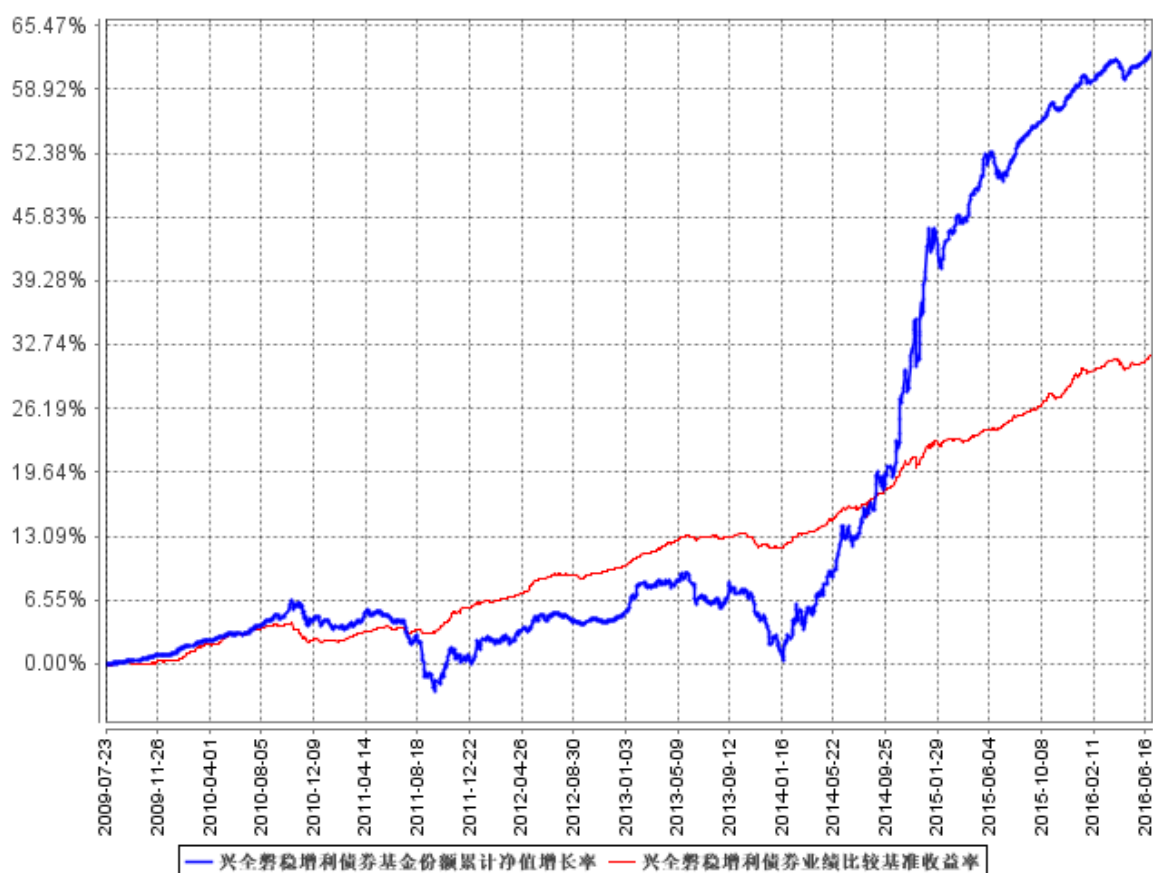
$$\text{Return}_t = 95\% \times (\text{中证全债指数}_t / \text{中证全债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

## 兴全磐稳增利债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2009 年 7 月 23 日至 2010 年 1 月 22 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业全球基金管理有限公司是经中国证监会（证监基字[2003]100 号文）批准，于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月 2 日，中国证监会批准（证监许可[2008]6 号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册

资本的 49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”。2008 年 7 月 7 日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币 1.2 亿元变更为人民币 1.5 亿元。

截止 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十七只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                  | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|---------------------|-----------------|------|--------|--|
|    |                     | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 张睿 | 本基金、兴全天添益货币市场基金基金经理 | 2015 年 11 月 2 日 | -    | 11 年   | 经济学硕士，历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴业全球基金管理有限公司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理。 |

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

## 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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信

于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

16 年上半年，宏观经济先扬后抑，债券收益率先升后降。

1~4 月，在一系列稳增长政策措施下，经济有所回暖，信贷数据创出历史最高值，同时，投资、生产、物价等多项指标呈现走高态势；叠加银行初次季末 MPA 考核，金融去杠杆压力，营改增带来不确定性以及信用违约事件集中连发多起，导致债券收益率在 15 年末因抢配资产而创下新低后，出现相当级别的反弹。

5~6 月，市场预期发生了逆转，同时，经济复苏被逐渐证伪，各项数据开始回落，通胀预期下降，海外市场因英国意外脱欧也提供了有利的外围环境。同期，实体对资金的需求下降，叠加银行体系内对高风险贷款明显收缩，部分富余资金通过委外形式投向非银机构，而非银机构的主要投向为债券类资产，这个进程进一步加速了债券收益率的下行。

本基金策略上偏向于配置思路，寻找久期适中的优质信用资产，同时部分参与利率债的波段操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率 2.16%，同期业绩比较基准收益率 1.56%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期而言，由于投资高峰已过、地产市场长周期拐点已经到来，我国宏观经济增速长期放缓趋势较为确定，名义增长率放缓将为长端收益率下行创造良好基础。无论是产能周期还是债务周期，中国都仍处于下行阶段，债市向好的基础犹存。展望中短期，债市在多个外部因素刺激下，已经经历了一波收益率的快速下行，利好预期兑现较多。本基金将继续以稳健配置策略为主，寻找合适的交易机会。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经验，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 半年度，基金托管人在兴全磐稳增利债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 半年度，兴业全球基金管理有限公司在兴全磐稳增利债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 半年度，由兴业全球基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴全磐稳增利债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴全磐稳增利债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号 | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-----|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |     |                        |                          |
| 银行存款        |     | 13,326,666.08          | 333,362,533.24           |
| 结算备付金       |     | 53,845,525.58          | 61,971,680.68            |
| 存出保证金       |     | 80,821.07              | 160,818.69               |
| 交易性金融资产     |     | 7,060,668,709.97       | 6,638,789,835.00         |
| 其中：股票投资     |     | -                      | -                        |
| 基金投资        |     | -                      | -                        |
| 债券投资        |     | 7,060,668,709.97       | 6,638,789,835.00         |

|                 |            |                                |                                  |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          |            | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        |            | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 44,851,625.57                  | 500,245,273.50                   |
| 应收利息            |            | 172,420,790.54                 | 120,840,663.03                   |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 8,463,189.42                   | 15,020,387.06                    |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            |            | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 7,353,657,328.23               | 7,670,391,191.20                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          |            | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 1,562,259,039.11               | 1,499,999,430.00                 |
| 应付证券清算款         |            | 45,579,402.14                  | -                                |
| 应付赎回款           |            | 10,257,405.22                  | 353,558,932.97                   |
| 应付管理人报酬         |            | 3,262,646.91                   | 3,574,027.66                     |
| 应付托管费           |            | 932,184.86                     | 1,021,150.77                     |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          |            | 28,088.70                      | 15,871.40                        |
| 应交税费            |            | 1,442,358.14                   | 1,442,358.14                     |
| 应付利息            |            | 210,069.56                     | 22,263.03                        |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            |            | 67,190.24                      | 219,931.04                       |
| 负债合计            |            | 1,624,038,384.88               | 1,859,853,965.01                 |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金            |            | 4,210,231,196.30               | 4,361,823,220.07                 |
| 未分配利润           |            | 1,519,387,747.05               | 1,448,714,006.12                 |
| 所有者权益合计         |            | 5,729,618,943.35               | 5,810,537,226.19                 |
| 负债和所有者权益总计      |            | 7,353,657,328.23               | 7,670,391,191.20                 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3609 元，基金份额总额 4,210,231,196.30 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全磐稳增利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号       | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|-----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |           | 160,241,998.60                           | 126,232,669.33                                |
| 1.利息收入                     |           | 174,379,220.53                           | 72,779,550.05                                 |
| 其中：存款利息收入                  |           | 781,797.75                               | 1,635,218.45                                  |
| 债券利息收入                     |           | 173,539,442.71                           | 69,620,233.03                                 |
| 资产支持证券利息收入                 |           | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |           | 57,980.07                                | 1,524,098.57                                  |
| 其他利息收入                     |           | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |           | 41,646,625.41                            | 40,562,600.34                                 |
| 其中：股票投资收益                  |           | -  | 1,020,976.68                                  |
| 基金投资收益                     |           | -  | -   |
| 债券投资收益                     |           | 41,646,625.41                            | 39,541,623.66                                 |
| 资产支持证券投资收益                 |           | -  | -   |
| 贵金属投资收益                    |           | -  | -   |
| 衍生工具收益                     |           | -  | -   |
| 股利收益                       |           | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |           | -59,388,241.66                           | -7,321,009.68                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |           | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          |           | 3,604,394.32                             | 20,211,528.62                                 |
| <b>减：二、费用</b>              |           | 36,954,858.35                            | 18,783,964.35                                 |
| 1. 管理人报酬                   |           | 22,069,399.57                            | 6,456,860.64                                  |
| 2. 托管费                     |           | 6,305,542.74                             | 1,844,817.29                                  |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.8.2.3 | -  | -   |
| 4. 交易费用                    |           | 57,220.29                                | 161,990.85                                    |
| 5. 利息支出                    |           | 8,435,077.43                             | 10,211,020.63                                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |           | 8,435,077.43                             | 10,211,020.63                                 |
| 6. 其他费用                    |           | 87,618.32                                | 109,274.94                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |           | 123,287,140.25                           | 107,448,704.98                                |
| 减：所得税费用                    |           | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |           | 123,287,140.25                           | 107,448,704.98                                |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全磐稳增利债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日      |                   |                    |
|--|--|-------------------|--------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润             | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 4,361,823,220.07                           | 1,448,714,006.12  | 5,810,537,226.19   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 123,287,140.25    | 123,287,140.25     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -151,592,023.77                            | -52,613,399.32    | -204,205,423.09    |
| 其中：1.基金申购款                             | 3,255,960,376.77                           | 1,123,629,444.52  | 4,379,589,821.29   |
| 2.基金赎回款                                | -3,407,552,400.54                          | -1,176,242,843.84 | -4,583,795,244.38  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -                 | -                  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 4,210,231,196.30                           | 1,519,387,747.05  | 5,729,618,943.35   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                   |                    |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润             | 所有者权益合计            |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 622,585,868.88                             | 216,537,942.31    | 839,123,811.19     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -  | 107,448,704.98    | 107,448,704.98     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 558,510,892.61                             | 1,480,071,974.16  | 2,038,582,866.77   |
| 其中：1.基金申购款                             | 8,544,472,684.84                           | 3,519,664,914.15  | 12,064,137,598.99  |
| 2.基金赎回款                                | -7,985,961,792.23                          | -2,039,592,939.99 | -10,025,554,732.22 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -1,500,051,226.15 | -1,500,051,226.15  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,181,096,761.49                           | 304,007,395.30    | 1,485,104,156.79   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|                            |                           |                            |
|----------------------------|---------------------------|----------------------------|
| <u>        庄园芳        </u> | <u>        杨东        </u> | <u>        詹鸿飞        </u> |
| 基金管理人负责人                   | 主管会计工作负责人                 | 会计机构负责人                    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全磐稳增利债券型证券投资基金(原名“兴业磐稳增利债券型证券投资基金”)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准兴业磐稳增利债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]385 号文)的核准,由兴业全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2009 年 7 月 23 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 1,417,943,495.87 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为“兴全磐稳增利债券型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》和《兴全磐稳增利债券型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他债券类金融工具。本基金不参与定向增发或网下新股申购,也不在二级市场直接买入股票、权证等权益类资产。本基金可以参与一级市场网上新股申购、公开增发,可以持有可转债转股所得股票及可分离债分离后所得权证,由上述方式获得的股票或权证将在可交易日起 5 个交易日内全部卖出。本基金可以主动投资于纯债收益率为正的可转债,不主动投资于纯债收益率为零或为负的可转债。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%,其中权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数×95%+同业存款利率×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作。另,自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内将全面推开营业税改征增值税。本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于增值税征收范围,不征收增值税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收增值税和企业所得税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                      | 与本基金的关系             |
|----------------------------|---------------------|
| 兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴业全球基金”） | 基金管理人，注册登记机构，基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）     | 基金托管人，基金销售机构        |
| 兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）     | 基金管理人的股东，基金销售机构     |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 兴业证券  | 1,139,744,036.34                      | 100.00%          | 974,993,320.00                             | 100.00%          |

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                    | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                        |
|-------|---------------------------------------|--------------------|--|------------------------|
|       | 回购成交金额                                | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                                     | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比例 |
| 兴业证券  | 48,925,337,000.00                     | 100.00%            | 27,323,815,000.00                          | 100.00%                |

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日      |                |           |                  |
|-------|--|----------------|-----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                                   | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 兴业证券  | -  | -              | -         | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                |           |                  |
|       | 当期<br>佣金                                   | 占当期佣金总量的<br>比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 兴业证券  | 60,790.65                                  | 100.00%        | 44,584.74 | 100.00%          |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月<br>30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30<br>日 |
|-----------------|------------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 22,069,399.57                      | 6,456,860.64                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,959,662.09                       | 434,741.26                         |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.70%/当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30<br>日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,305,542.74                             | 1,844,817.29                                  |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日      |               |      |       |      |       |      |
|--|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|  | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 交通银行                                       | 32,001,149.02 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|  | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |

本基金上年度可比期间未与关联方进行银同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的管理人报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |            | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |              |
|-------|---------------------------------------|------------|--|--------------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入     | 期末余额                                       | 当期利息收入       |
| 交通银行  | 13,326,666.08                         | 408,064.72 | 10,863,145.64                              | 1,438,842.08 |

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.10.1.2 受限证券类别：债券 |      |                 |                |        |        |        |          |            |            |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日           | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 127003               | 海印转债 | 2016 年 6 月 15 日 | 2016 年 7 月 1 日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 8,780    | 878,000.00 | 878,000.00 | -  |

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 101560051 | 15 九洲通 MTN001 | 2016 年 7 月 1 日 | 102.90 | 1,000,000 | 102,900,000.00 |
| 101564048 | 15 步步高        | 2016 年 7 月 1 日 | 102.10 | 500,000   | 51,050,000.00  |

|           |                    |                   |        |           |                |
|-----------|--------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
|           | MTN001             | 日                 |        |           |                |
| 101564054 | 15 蒙君正<br>MTN002   | 2016 年 7 月 1<br>日 | 99.92  | 600,000   | 59,952,000.00  |
| 101663004 | 16 山西交<br>投 MTN001 | 2016 年 7 月 1<br>日 | 102.12 | 419,000   | 42,788,280.00  |
| 041672001 | 16 鲁高速<br>CP001    | 2016 年 7 月 6<br>日 | 100.02 | 1,770,000 | 177,035,400.00 |
| 101555025 | 15 济南高<br>新 MTN002 | 2016 年 7 月 6<br>日 | 104.86 | 1,000,000 | 104,860,000.00 |
| 101564054 | 15 蒙君正<br>MTN002   | 2016 年 7 月 6<br>日 | 99.92  | 100,000   | 9,992,000.00   |
| 041651020 | 16 大族控<br>股 CP001  | 2016 年 7 月 7<br>日 | 100.25 | 120,000   | 12,030,000.00  |
| 101353012 | 13 步步高<br>MTN001   | 2016 年 7 月 7<br>日 | 104.23 | 1,000,000 | 104,230,000.00 |
| 101563007 | 15 友阿<br>MTN001    | 2016 年 7 月 7<br>日 | 103.75 | 700,000   | 72,625,000.00  |
| 101662033 | 16 海兴投<br>资 MTN001 | 2016 年 7 月 7<br>日 | 99.41  | 500,000   | 49,705,000.00  |
| 合计        |                    |                   |        | 7,709,000 | 787,167,680.00 |

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 815,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日和 6 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|--------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资   | —                | —                |
|    | 其中：股票  | —                | —                |
| 2  | 固定收益投资 | 7,060,668,709.97 | 96.02            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 7,060,668,709.97 | 96.02  |
|   | 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      | 67,172,191.66    | 0.91   |
| 7 | 其他各项资产            | 225,816,426.60   | 3.07   |
| 8 | 合计                | 7,353,657,328.23 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期间未投资股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期间未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期间未投资股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 278,454,000.00   | 4.86         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 51,965,000.00    | 0.91         |
|    | 其中：政策性金融债 | 51,965,000.00    | 0.91         |
| 4  | 企业债券      | 2,395,833,458.77 | 41.81        |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 5  | 企业短期融资券   | 1,322,275,000.00 | 23.08  |
| 6  | 中期票据      | 2,851,812,000.00 | 49.77  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 160,329,251.20   | 2.80   |
| 8  | 同业存单      | —                | —      |
| 9  | 其他        | —                | —      |
| 10 | 合计        | 7,060,668,709.97 | 123.23 |

## 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称           | 数量（张）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 101569028 | 15 泛海 MTN001   | 2,000,000 | 205,760,000.00 | 3.59         |
| 2  | 011599970 | 15 泸州窖 SCP002  | 2,000,000 | 200,800,000.00 | 3.50         |
| 3  | 041672001 | 16 鲁高速 CP001   | 2,000,000 | 200,040,000.00 | 3.49         |
| 4  | 011699947 | 16 长江电力 SCP002 | 2,000,000 | 199,920,000.00 | 3.49         |
| 5  | 101560065 | 15 中铝 MTN003   | 2,000,000 | 199,060,000.00 | 3.47         |

## 7.7 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。

## 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额             |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 80,821.07      |
| 2  | 应收证券清算款 | 44,851,625.57  |
| 3  | 应收股利    | —              |
| 4  | 应收利息    | 172,420,790.54 |
| 5  | 应收申购款   | 8,463,189.42   |
| 6  | 其他应收款   | —              |
| 7  | 待摊费用    | —              |
| 8  | 其他      | —              |
| 9  | 合计      | 225,816,426.60 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 113008 | 电气转债     | 36,757,400.00 | 0.64         |
| 2  | 117009 | 九洲可交债    | 30,825,000.00 | 0.54         |
| 3  | 132001 | 14 宝钢 EB | 11,639,808.00 | 0.20         |
| 4  | 123001 | 蓝标转债     | 5,546,119.20  | 0.10         |
| 5  | 117014 | 15 大族 01 | 3,727,080.00  | 0.07         |
| 6  | 110030 | 格力转债     | 1,150,039.50  | 0.02         |
| 7  | 128009 | 歌尔转债     | 770,164.20    | 0.01         |
| 8  | 110031 | 航信转债     | 526,083.30    | 0.01         |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期间未投资股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构            |            |                  |            |
|--------------|---------------|------------------|------------|------------------|------------|
|              |               | 机构投资者            |            | 个人投资者            |            |
|              |               | 持有份额             | 占总份<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 35,597       | 118,274.89    | 2,744,054,769.27 | 65.18%     | 1,466,176,427.03 | 34.82%     |

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员<br>持有本基金 | 92,817.53 | 0.0022%  |

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部<br>门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2009年7月23日）基金份额总额 | 1,417,943,495.87 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 4,361,823,220.07 |
| 本报告期基金总申购份额               | 3,255,960,376.77 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 3,407,552,400.54 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 4,210,231,196.30 |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

2016 年 5 月 9 日公告，自 2016 年 5 月 9 日起公司董事长、法定代表人由兰荣先生变更为庄园芳女士；

2016 年 1 月 13 日公告，自 2016 年 1 月 13 日起郑文惠女士任公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 兴业证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易             |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|------------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额             | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 1,139,744,036.34 | 100.00%      | 48,925,337,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司  
2016 年 8 月 24 日