

# 兴全稳益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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	兴全稳益债券
场内简称	-
基金主代码	001819
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	2015 年 9 月 10 日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,011,898,479.56 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	在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，积极利用各种稳健的固定收益类投资工具实现基金资产长期、稳定的投资回报。
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	本基金业绩比较基准=中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低预期风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777

	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

## 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	http://www.xyfunds.com.cn
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	41,773,947.70
本期利润	44,662,375.30
加权平均基金份额本期利润	0.0353
本期基金份额净值增长率	3.26%
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	0.0086
期末基金资产净值	2,040,809,048.71
期末基金份额净值	1.014

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。

4、本基金基金合同于2015年9月10日生效，截至2016年6月30日，本基金成立不满一年。

## 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.00%	0.06%	0.72%	0.05%	0.28%	0.01%
过去三个月	1.30%	0.05%	0.36%	0.06%	0.94%	-0.01%
过去六个月	3.26%	0.05%	1.62%	0.06%	1.64%	-0.01%
自基金合同生效以来	6.46%	0.11%	4.81%	0.07%	1.65%	0.04%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证全债指数收益率，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，也是中证指数有限公司编制并发布的首只债券类指数。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，中证指数有限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，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价，能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

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：

$$\text{Return}_t = \text{中证全债指数收益率}_t / \text{中证全债指数收益率}_{t-1} - 1$$

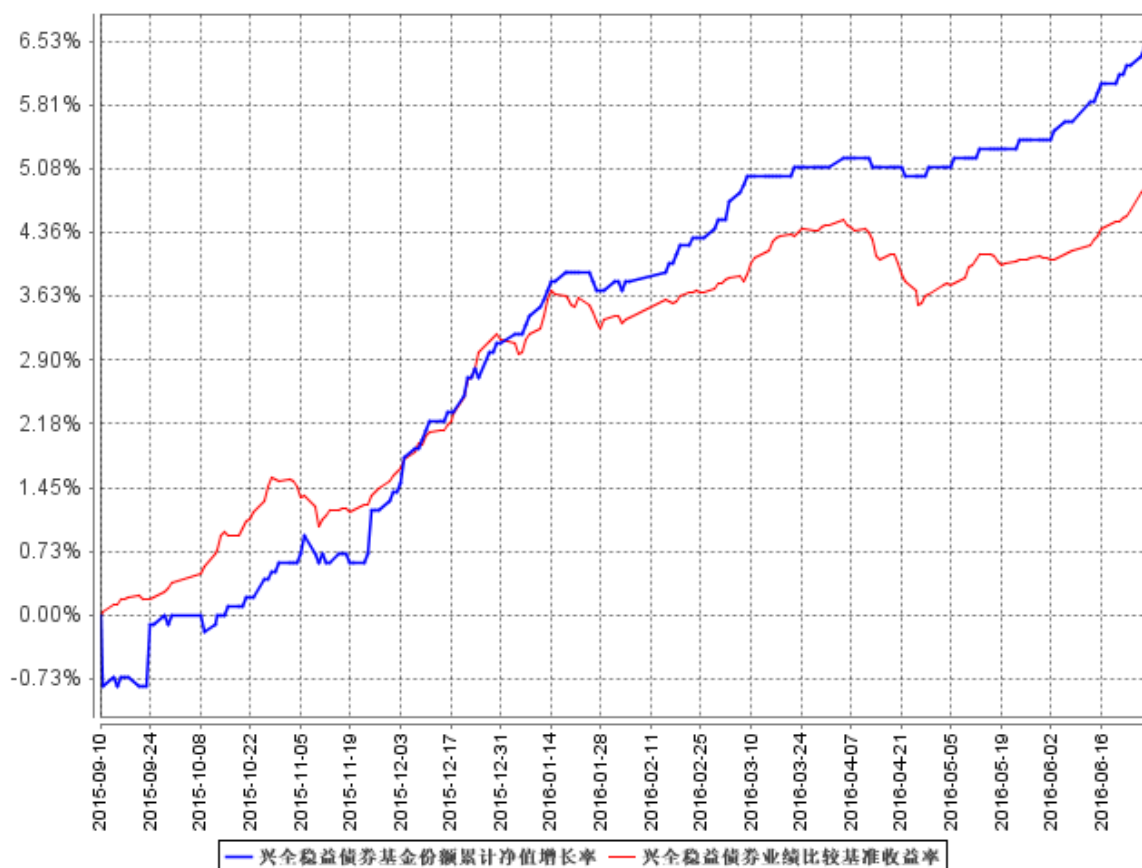
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

2、本基金成立于 2015 年 9 月 10 日，截止 2016 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

### 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

## 兴全稳益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《兴全稳益债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的建仓期为自 2015 年 9 月 10 日至 2016 年 3 月 9 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本基金投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2015 年 9 月 10 日，截止 2016 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

## § 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		
钟明	固定收益部总监助理兼本基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全货币市场证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理	2015 年 9 月 17 日	-	11 年	工商管理硕士，历任兴业全球基金管理有限公司基金会计、交易员、基金经理助理。

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合规守信情况的说明

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、《兴全稳益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

上半年信贷、社融冲高回落，房地产销售及基建投资火爆开局后，在二季度也出现明显降温，经济企稳预期落空，权威人士发言强调供给侧改革的重要性，经济运行将在一个阶段呈现 L 型，债市情绪经历纠结、谨慎、矛盾到二季度的一致性看多，债券收益率也在震荡中下行。货币政策方面，人民币汇率贬值压力，及年初寒冷天气导致食品价格大幅上升，加上房价、大宗商品暴涨，通胀预期抬头，对宽松货币政策形成压制，一季度末虽有降准但仅对冲由外汇流出带来的流动性缺口，央行仍主要通过公开市场逆回购及 MLF 等工具投放短期流动性，来灵活稳定资金面，保持流动性充裕。上半年债市信用违约事件的爆发势如破竹，从私募蔓延到公募，民企蔓延到央企，刚性兑付信仰完全打破，信用债市场在 4 月份经历大幅调整，风险偏好回落至低点，信用利差重回高位，但在基本面支撑及配置压力和负债端成本刚性的推动下，至 6 月末时期限利差及信用利



差已恢复到历史低位。本组合配置上较为谨慎，在信用利差及期限利差过低，加上经济疲软，企业盈利难改善的情形下，对信用风险保持高度警惕，倾向短久期、城投债及利率债为主。

#### 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 3.26%，同期业绩比较基准收益率 1.62%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济变化倒逼改革提速，下半年将加大通过供给侧结构性改革、兼并重组化解过剩产能，改善经济结构性问题。金融监管领域近期各项政策陆续出台，加强对潜在风险的自查工作，以及对业务审批的从严监管，积极防患金融系统风险发生。从政策来看，下半年经济托底可能更依赖积极的财政政策、宽松的货币政策，防止风险延续，通胀压力减缓也给政策灵活性带来较大空间，流动性环境将继续保持充裕。在经济基本面持续疲弱，企业盈利难改善，加上去产能、降杠杆工作的持续推进，企业融资环境恶化，信用风险仍不容小觑。本组合将继续保持对信用风险的警惕，着重于有利差保护的个券配置，在资金成本相对刚性、息差过低的情况下，谨慎加杠杆操作。

### 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》、《兴全稳益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，本基金实施利润分配 1 次，共分配利润 55,572,376.73 元，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**

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### **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**

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：兴全稳益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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,114,534.74	92,582,097.78
结算备付金		-	380,952.38
存出保证金		14,846.61	59,755.22
交易性金融资产	6.4.7.2	2,074,560,400.00	962,864,265.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,074,560,400.00	962,864,265.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	16,361,326.66	27,896,400.53
应收股利		-	-
应收申购款		313,567.80	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,101,364,675.81	1,083,783,470.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		59,849,790.22	49,999,725.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		36,516.77	-
应付管理人报酬		425,468.85	217,383.32
应付托管费		170,187.53	86,953.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,228.18	10,937.50
应交税费		-	-

应付利息		5,277.09	30,822.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	62,158.46	35,000.00
负债合计		60,555,627.10	50,380,821.55
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,011,898,479.56	1,002,022,045.49
未分配利润	6.4.7.10	28,910,569.15	31,380,603.87
所有者权益合计		2,040,809,048.71	1,033,402,649.36
负债和所有者权益总计		2,101,364,675.81	1,083,783,470.91

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.014 元，基金份额总额 2,011,898,479.56 份。

2、本基金合同于 2015 年 9 月 10 日生效，上期财务报表的实际编制期间为 2015 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全稳益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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		48,089,151.78	-
1.利息收入		29,297,156.58	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,718,135.52	-
债券利息收入		27,540,904.90	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		38,116.16	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,800,492.57	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,800,492.57	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,888,427.60	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	103,075.03	-
<b>减：二、费用</b>		3,426,776.48	-
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	1,605,694.54	-
2. 托管费	6.4.9.2.2	642,277.82	-
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,753.81	-
5. 利息支出		1,079,346.85	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,079,346.85	-
6. 其他费用	6.4.7.20	81,703.46	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		44,662,375.30	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		44,662,375.30	-

注：本基金合同于 2015 年 9 月 10 日生效，故不存在上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全稳益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 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）	1,002,022,045.49	31,380,603.87	1,033,402,649.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	44,662,375.30	44,662,375.30
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）	1,009,876,434.07	8,439,966.71	1,018,316,400.78
其中：1.基金申购款	1,112,769,653.75	9,382,063.33	1,122,151,717.08
2.基金赎回款	-102,893,219.68	-942,096.62	-103,835,316.30
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）	-	-55,572,376.73	-55,572,376.73
五、期末所有者权益（基金净值）	2,011,898,479.56	28,910,569.15	2,040,809,048.71



本基金投资范围为以下金融工具：国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、可转换债券(不得转股)、债券回购、银行存款等固定收益类资产。本基金也可投资于法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金为债券型基金，各类资产的投资比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

本基金的业绩比较基准为中证全债指数收益率。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

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**

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《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》、国税函[2008]870 号《关于做好证券市场个人

投资者证券交易结算资金利息所得免征个人所得税工作的通知》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。主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于增值税征收范围，不缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人
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

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。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	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 成交总额的比例
兴业证券	20,515,542.47	100.00%	-	-

注：本基金合同于 2015 年 9 月 10 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易



本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 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30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,605,694.54	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.25% 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\*0.25%/当年天数。

2、本基金合同于 2015 年 9 月 10 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

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30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	642,277.82	-

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 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\*0.1%/当年天数。

2、本基金合同于 2015 年 9 月 10 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 6.4.9.2.3 销售服务费

无

### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.9.4.2 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
基金托管人	1,994,435,511.00	99.1300%	998,420,072.40	99.6405%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

**6.4.9.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 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
兴业银行	10,114,534.74	708,699.95	-	-

注：本基金合同于2015年9月10日生效，故不存在上年度可比期间。

**6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**6.4.9.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期间无其他关联交易事项。

**6.4.10 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.10.2 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临时停牌等流通受限证券。

**6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 59,849,790.22 元，是以如下债券作为抵押：

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
011699376	16 沪电力 SCP001	2016 年 7 月 7 日	99.98	600,000	59,988,000.00
合计				600,000	59,988,000.00

#### 6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.11 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 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	2,074,560,400.00	98.72
	其中：债券	2,074,560,400.00	98.72
	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	10,114,534.74	0.48
7	其他各项资产	16,689,741.07	0.79
8	合计	2,101,364,675.81	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,202,766,000.00	58.94
	其中：政策性金融债	1,202,766,000.00	58.94
4	企业债券	134,517,200.00	6.59
5	企业短期融资券	721,074,000.00	35.33
6	中期票据	16,203,200.00	0.79
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,074,560,400.00	101.65

**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	100224	10 国开 24	10,000,000	947,100,000.00	46.41
2	120224	12 国开 24	1,500,000	145,860,000.00	7.15
3	011599735	15 澜沧江 SCP004	1,000,000	100,470,000.00	4.92
4	041555048	15 华谊 CP001	1,000,000	100,320,000.00	4.92
5	011699247	16 国电 SCP002	1,000,000	100,100,000.00	4.90
5	011699255	16 中粮 SCP001	1,000,000	100,100,000.00	4.90

**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。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.10.3 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。

**7.11 投资组合报告附注**

**7.11.1** 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。

**7.11.2** 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。

### 7.11.3 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	14,846.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,361,326.66
5	应收申购款	313,567.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,689,741.07

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资股票。

### 7.11.6 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 (户)	户均持有的基 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 额比例	持有份额	占总份 额比例
322	6,248,131.92	1,994,435,510.62	99.13%	17,462,968.94	0.87%

## 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持有本基金	591,160.52	0.0294%

## 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月10日）基金份额总额	202,416,128.67
本报告期期初基金份额总额	1,002,022,045.49
本报告期基金总申购份额	1,112,769,653.75
减：本报告期基金总赎回份额	102,893,219.68
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	2,011,898,479.56

注：总申购份额含红利再投资。

## § 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——德勤华永会计师事务所（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、基金托管人及其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	20,515,542.47	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