

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年年度报告

2016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

送出日期：2017年3月31日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28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。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6	审计报告	14
6.1	审计报告基本信息	14
6.2	审计报告的基本内容	15
§7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	21
§8	投资组合报告	42
8.1	期末基金资产组合情况	42
8.2.1	报告期末按行业分类的境内股票投资组合	43
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.6	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	43
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
8.8	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	44
8.9	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	44
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
8.12	投资组合报告附注	45
§9	基金份额持有人信息	46
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46

9.3 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情况 .....	46
§10 开放式基金份额变动 .....	46
§11 重大事件揭示 .....	47
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
11.2 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 .....	47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
11.4 基金投资策略的改变 .....	47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
11.8 其他重大事件 .....	48
§12 备查文件目录 .....	50
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金
基金简称	兴业稳固收益两年理财债券
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	1,848,424,447.64
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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	兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	朱玮	王永民
	联系电话	021-22211888	010-66594896
	电子邮箱	renjb@cib-fund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40000-95561	95566
传真		021-22211997	010-66594942
注册地址		福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		卓新章	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2016年	2015年6月10日（基金
----------------------	-------	---------------

		合同生效日)-2015年 12月31日
本期已实现收益	42,915,025.97	28,878,755.36
本期利润	42,915,025.97	28,878,755.36
加权平均基金份额本期利润	0.0232	0.0156
本期加权平均净值利润率	2.29%	1.55%
本期基金份额净值增长率	2.30%	1.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	32,976,867.29	28,878,755.36
期末可供分配基金份额利润	0.0178	0.0156
期末基金资产净值	1,881,401,314.93	1,877,303,203.00
期末基金份额净值	1.018	1.016
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	3.94%	1.60%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 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

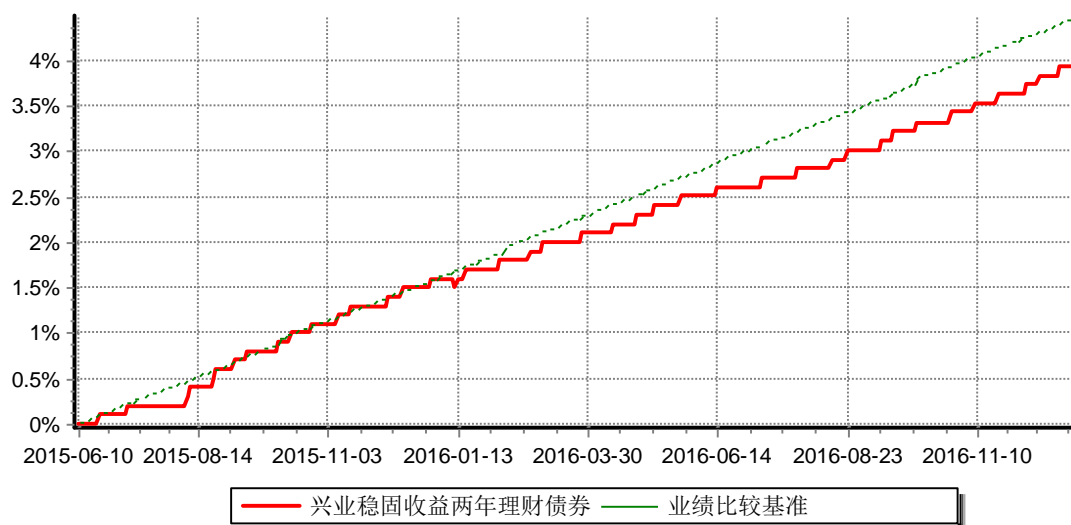
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.69%	0.03%	0.69%	0.01%	—	0.02%
过去六个月	1.29%	0.03%	1.39%	0.01%	-0.10%	0.02%
过去一年	2.30%	0.03%	2.81%	0.01%	-0.51%	0.02%
自基金合同生效日起至今	3.94%	0.03%	4.45%	0.01%	-0.51%	0.02%

注：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）。

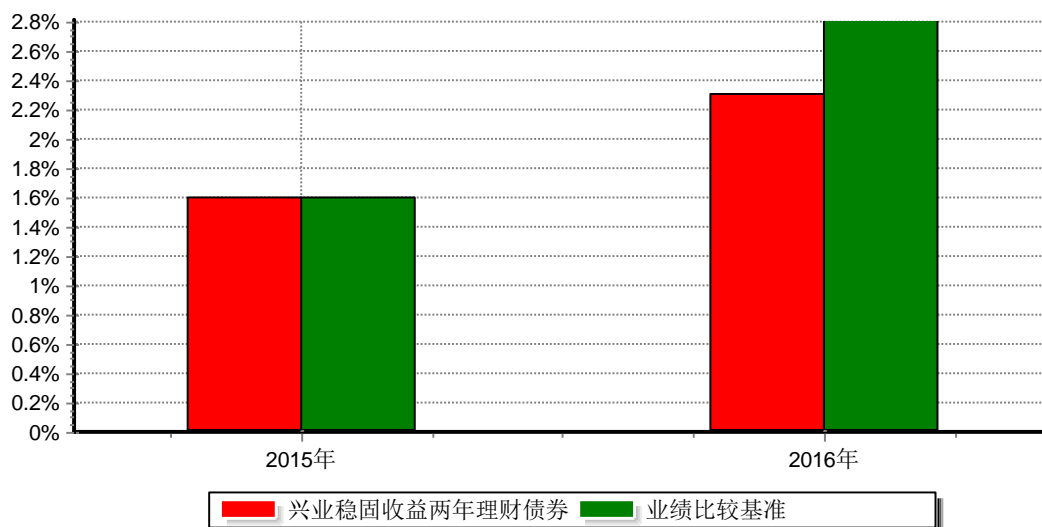
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率对比图



注：本基金基金合同于2015年6月10日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.21	38,816,914.04	—	38,816,914.04	
2015年	—	—	—	—	
合计	0.21	38,816,914.04	—	38,816,914.04	

## § 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

2013年3月，兴业基金管理有限公司获中国证监会批复。兴业基金由兴业银行股份有限公司和中海集团投资有限公司共同出资设立，公司注册资本7亿元人民币，注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至2016年12月31日，兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、兴业收益增强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、兴业稳固收益一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、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业聚盛灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚宝灵活配置混合型证券投资基金、兴业保本混合型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业天禧债券型证券投资基金、兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚源灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金、兴业14天理财债券型证券投资基金、中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金、兴业裕恒债券型证券投资基金、兴业裕华债券型证券投资基金。

#### 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		
徐莹	本基金的基金经理	2015年6月10日	2016年12月12日	8	中国籍，硕士学位，CFA，具有证券投资基金从业资格。2008年7月至2012年5月，在兴业银行总行资金营运中心从事债券交易、债券投资；2012年5月至2013年6月，在兴业银行总行资产管理部从事组合投资管理；2013年6月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。
杨逸君	本基金的基金经理	2015年11月9日	—	6	中国籍，硕士学位，金融风险管理师（FRM），具有证券投资基金从业资格。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，现任基金经理。

注：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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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 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

2016年经济总体保持平稳增长，经济L型延续，尤其是第三季度后回升势头有所加快，通胀压力有所上升。从债券市场看，上半年受信用事件频发，叠加地方债专项金融债供给冲击、MPA考核等资金面因素影响，债券收益率整体走高；后受基本面支撑、英国脱欧公投、理财配置资金推动等因素影响，债市收益率下行明显；第三季度以来，国内经济基本利好因素不断显现，外围受美国加息靴子落地以及美国总统大选、意大利公投失败等黑天鹅事件影响，主要发达国家国债收益率大幅上行，人民币贬值压力持续攀升，国内货币政策边际收紧，债市“去杠杆”背景下，央行公开市场“锁短放长”，对利率波动弹性容忍度增加，叠加债市黑天鹅、货基赎回等因素，造成国内债券及资金市场大幅调整。报告期内，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，严格把握债券的信用风险，适当降低风险偏好，适当缩短组合久期。

#### 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2.30%，同期业绩比较基准收益率为2.81%。

#### 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2017年，从国际上看，全球经济总体呈现复苏态势，部分发达经济体增长可能加快，但仍面临复杂多变的国际环境，如国际政治经济社会领域的“黑天鹅”事件可能增多，民粹主义和逆全球化的影响可能加大，主要发达国家货币政策外溢效应影响存在不确定性等。从国内经济看，2016年三季度以来经济和通胀有阶段性的回升，但此轮基于补库存周期与供给侧改革下的经济内生增长动力及持续性存在不确定性，表现在：工业企业利润短期改善，但产能过剩未有根本性好转；房地产行业景气度可能会对经济动能形成牵制；基建投资受制于财政扩张空间有限，需PPP、专项金融债等融资工具助力；受收入增速下滑及实际利率影响，消费增速或维持偏稳定或小幅下滑；在中国出口占比高、全球贸易保护抬头等背景下，出口空间增长有限。通胀短升长降，面临供给侧改革节奏与油价等不确定因素影响，人民币汇率贬值压力继续存在。货币政策方面，预计在经济不存在明显下行压力的情况下将维持稳健中性，以控风险和防控资产价格泡沫为主。资金方面，虽然广义流动性充裕，但在外部美联储加息等长期因素叠加，内部政策“去杠杆”、MPA考核以及资管政策出台等因素影响下，未来短期性、结构性流动性紧张将延续，利率波动将进一步上升。在此背景下，我们对2017年上半年债券市场持中性谨慎态度，将密切关注央行监管政策的变化以及外围美元周期带来的影响，在警惕流动性以及信用风险的大前提下，采取较为稳健的操作策略，短久期债券提供流动性，长久期债券跟随市场节奏博取收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法经营、规范运作、勤勉尽责、保障基金持有人利益出发，严守合规底线、完善内部控制，2016年度主要从如下几个方面落实风险控制、强化监察稽核职能：

1、进一步完善公司内控制度及业务流程：报告期内公司进一步对内部制度进行梳理和完善，对公司业务运作和经营管理进行全方位的规范，逐步完善内部控制标准与要求。

2、加强业务合规及信息披露审核：随着公司管理资产规模扩大以及产品线进一步丰富，公司持续加强对信息披露材料、营销材料、产品方案等开展合规审核，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性，保证各项对外营销活动和宣传推介合法合规；

3、全面实施投资监督和风险监测：公司严格遵照法律法规、基金合同和公司制度要求对日常投资运作进行管理和监控，对基金运作合规情况进行监控并跟踪分析异常指标，及时沟通及风险提示，全方位防范控制基金运作风险。

4、开展各项稽核审计工作：根据法规要求,组织开展定期稽核、特定人员离任审计，依据风险导向组织重点业务领域专项审计，根据监管要求组织各项自查，对产品运作、

业务开展合规性及内控完善性进行审查，不断促进公司内控制度执行有效。

5、加强员工合规管理：报告期内公司通过线上、线下多种方式组织开展员工合规培训，加强对员工职业操守的教育和监督，提升员工合规遵从意识；组织开展定期常规信息管制抽查，以及异常行为专项排查，加强员工行为监督，强化员工合规管理。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续本着诚实信用、勤勉尽责的原则，坚持风险控制为核心，确保管理基金的合规、安全运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任；委员若干名，由基金运营部、风险管理总部、研究部、投资管理总部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

###### (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

###### (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

##### 4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

##### 5、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定：本基金收益分配方式为现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

2016年4月21日，本基金现金分红38,816,914.04。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

#### 4.9 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

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 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	德师报(审)字(17)第P01197号
--------	---------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金全体持有人
引言段	我们审计了后附的兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金(以下简称"兴业稳固收益两年理财债券")的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表,2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是兴业稳固收益两年理财债券的基金管理人兴业基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p>

	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，兴业稳固收益两年理财债券的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴业稳固收益两年理财债券2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	曾浩、吴凌志
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	上海市延安东路222号外滩中心30楼
审计报告日期	2017-03-24

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	164,081,984.88	138,528,709.29
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	7.4.7.2	1,590,434,180.72	1,715,114,040.52
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,503,694,527.11	1,438,702,498.11
资产支持证券投资		86,739,653.61	276,411,542.41
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—



兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年年度报告

买入返售金融资产	7.4.7.4	100,998,551.50	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	27,374,006.06	25,037,565.15
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		1,882,888,723.16	1,878,680,314.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		954,813.39	955,580.95
应付托管费		159,135.59	159,263.51
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	13,459.25	2,267.50
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	360,000.00	260,000.00
负债合计		1,487,408.23	1,377,111.96
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,848,424,447.64	1,848,424,447.64
未分配利润	7.4.7.10	32,976,867.29	28,878,755.36

所有者权益合计		1,881,401,314.93	1,877,303,203.00
负债和所有者权益总计		1,882,888,723.16	1,878,680,314.96

注：1.报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.018元，基金份额总额1,848,424,447.64份。

2、本基金2015年6月10日成立，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

## 7.2 利润表

会计主体：兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月10日（基金 合同生效日）至2015 年12月31日
一、收入		56,659,624.51	36,433,940.95
1.利息收入		56,422,866.58	34,559,556.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,574,485.36	3,205,739.44
债券利息收入		47,201,886.89	25,106,851.19
资产支持证券利息收入		4,541,715.90	4,052,991.58
买入返售金融资产收入		2,104,778.43	2,193,974.49
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		236,757.93	1,874,384.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	-998,710.90	1,334,176.29
资产支持证券投资收益		1,235,468.83	540,207.96
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	—	—

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	—	—
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	—	—
<b>减：二、费用</b>		13,744,598.54	7,555,185.59
1. 管理人报酬		11,222,551.84	6,244,705.57
2. 托管费		1,870,425.31	1,040,784.27
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	—	75.75
5. 利息支出		240,756.72	—
其中：卖出回购金融资产支出		240,756.72	—
6. 其他费用	7.4.7.19	410,864.67	269,620.00
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		42,915,025.97	28,878,755.36
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		42,915,025.97	28,878,755.36

注：本基金2015年6月10日成立，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	1,848,424,447.64	28,878,755.36	1,877,303,203.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	42,915,025.97	42,915,025.97

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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
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)	—	-38,816,914.04	-38,816,914.04
五、期末所有者权益(基金净值)	1,848,424,447.64	32,976,867.29	1,881,401,314.93
项 目	上年度可比期间 2015年6月10日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	1,848,424,447.64	—	1,848,424,447.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	28,878,755.36	28,878,755.36
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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
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)	1,848,424,447.64	28,878,755.36	1,877,303,203.00

注：本基金2015年6月10日成立，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

卓新章

黄文锋

莫艳鸿

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")以证监许可[2015]861号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为1,848,424,447.64份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(15)第0884号的验资报告。基金合同于2015年6月10日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期公司债券、分离交易可转债所分离出的纯债部分、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金不进行股票等权益类资产的投资。本基金不投资可转换债券,但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为: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)。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及

2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 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相一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2015年6月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 金融资产的分

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产以交易性金融资产列示，包括债券投资、资产支持证券投资等。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

###### 金融负债的分

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以交易性金融负债列示。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

- 债券投资

买入银行间市场交易的债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

买入央行票据和零息债券等贴现债券,债券投资成本于交易日按应付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

卖出银行间市场交易的债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

#### - 资产支持证券投资

买入资产支持证券于交易日确认为资产支持证券投资。基金持有的资产支持证券视同债券,购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本。

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益。卖出资产支持证券按移动加权平均法结转成本。

### 2) 贷款及应收款

#### - 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

### 3) 其他金融负债

#### - 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

本基金的债券投资等金融资产，均以实际利率法计算的摊余成本估算公允价值。

如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法计价。有新增事项，按国家相关法律法规规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。



#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### - 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

基金持有的付息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按摊余成本和实际收益率计算确认利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### - 投资收益

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券摊余成本与应收利息(若有)后的差额确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1)本基金收益分配方式为现金分红；

2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3)每一基金份额享有同等分配权；

4)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2)证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖

股票、债券免征营业税和增值税。

3)对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。

4)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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	9,081,984.88	38,528,709.29
定期存款	155,000,000.00	100,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	155,000,000.00	100,000,000.00
其他存款	—	—
合计	164,081,984.88	138,528,709.29

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	1,503,694,527.11	1,503,694,527.11
	合计	1,503,694,527.11	1,503,694,527.11
资产支持证券	86,739,653.61	86,739,653.61	—
基金	—	—	—

其他		—	—	—
合计		1,590,434,180.72	1,590,434,180.72	—
项目	上年度末 2015年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	1,438,702,498.11	1,438,702,498.11	—
	合计	1,438,702,498.11	1,438,702,498.11	—
资产支持证券		276,411,542.41	276,411,542.41	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,715,114,040.52	1,715,114,040.52	—

注：本基金交易性金融资产采用摊余成本计量。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	100,998,551.50	—
合计	100,998,551.50	—
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	—	—
合计	—	—

注：本基金上年度末未持有各项买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	7,249.48	15,234.80
应收定期存款利息	555,485.96	374,305.61
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	—	—
应收债券利息	26,645,031.93	23,506,896.33
应收买入返售证券利息	130,687.05	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	35,551.64	1,141,128.41
合计	27,374,006.06	25,037,565.15

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	13,459.25	2,267.50
合计	13,459.25	2,267.50

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
预提费用	360,000.00	260,000.00
合计	360,000.00	260,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,848,424,447.64	1,848,424,447.64
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	1,848,424,447.64	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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,878,755.36	—	28,878,755.36
本期利润	42,915,025.97	—	42,915,025.97
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-38,816,914.04	—	-38,816,914.04
本期末	32,976,867.29	—	32,976,867.29

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12	上年度可比期间 2015年6月10日（基金合同

	月31日	生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	210,188.92	1,464,034.08
定期存款利息收入	2,363,971.68	1,718,888.95
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	324.76	22,816.41
其他	—	—
合计	2,574,485.36	3,205,739.44

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-998,710.90	1,334,176.29
债券投资收益——赎回差价收入	—	—
债券投资收益——申购差价收入	—	—
合计	-998,710.90	1,334,176.29

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
----	-----------------------------	--

		日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,169,726,916.97	289,898,173.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,120,711,150.61	278,514,856.37
减：应收利息总额	50,014,477.26	10,049,140.65
买卖债券差价收入	-998,710.90	1,334,176.29

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	347,864,352.37	99,908,995.43
减：卖出资产支持证券成本总额	343,565,851.17	97,016,222.04
减：应收利息总额	3,063,032.37	2,352,565.43
资产支持证券投资收益	1,235,468.83	540,207.96

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期间及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。



#### 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	—	—
银行间市场交易费用	—	75.75
合计	—	75.75

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年6月10日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	280,000.00	180,000.00
开户费	4,800.00	6,600.00
帐户维护费	32,400.00	—
汇划手续费	13,664.67	3,020.00
合计	410,864.67	269,620.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2017年1月11日，本基金管理人发布《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2017年第1次分红公告》，收益分配基准日为2017年1月5日，权益登记日、除息日为2017

年1月12日，红利发放日为2017年1月13日，收益分配方案为按每10份基金份额派发红利人民币0.18元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	基金托管人
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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12月31日	2015年6月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,222,551.84	6,244,705.57
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

#### 7.4.10.2.2 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12月31日	2015年6月10日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,870,425.31	1,040,784.27

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易的情况。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.4.2 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		上年度末	
	2016年12月31日		2015年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	额占基金总份 额的比例	基金份额	额占基金总份 额的比例
兴业银行	1,847,999,000.0 0	99.98%	1,847,999,000.0 0	99.98%

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年6月10日（基金合同生效 日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	9,081,984.88	210,188.92	38,528,709.29	1,464,034.08
兴业银行	—	—	—	746,666.67

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份基金 份额分红数	现金形 式 发放	再投资形式 发放	利润分 配 合计	备注
	2016-04 -21		2016 -04- 21	0.210	38,816,9 14.04	—	38,816,9 14.04	
合计				0.210	38,816,9 14.04	—	38,816,9 14.04	

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

#### **7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金投资范围是具有良好流动性的固定收益类金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产，也不参与一级市场新股的申购或增发，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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对影响市场各类要素的分析以及投资组合的积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益。使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金”的风险收益目标。

本基金的基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金管理人建立的风险管理体系由三个风险防范等级构成：

一级风险防范是指在公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；负责对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指在公司风险控制委员会，投资决策委员会和风险管理总部层次对公司风险进行的预防和控制。经理层下设风险控制委员会，对公司在经营管理和基金运

作中的风险进行全面的分析、评估，制定相应的风险控制制度并监督制度的执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。

三级风险防范是公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量分析方法去估算各种风险产生的可能损失。从定性分析判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度，从定量分析建立风险量化指标、模型，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险又称违约风险，是指借款人、证券发行人或交易对方因各种原因，不愿或无力履行合同条件而构成违约，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了较完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。最后，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金报告期末按信用评级列示的债券投资不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	150,105,850.57	—
A-1以下	—	—
未评级	739,085,990.88	173,266,295.02
合计	889,191,841.45	173,266,295.02

### 7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	295,162,187.62	1,032,369,297.64
AAA以下	37,952,949.70	509,478,447.86
未评级	—	—
合计	333,115,137.32	1,541,847,745.50

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。此外，本基金管理人采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析和监测持有个券的市场交易状况、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	164,081,984.88	—	—	—	164,081,984.88
交易性金融资产	1,590,434,180.72	—	—	—	1,590,434,180.72

兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年年度报告

买入返售金融资产	100,998,551.50	—	—	—	100,998,551.50
应收利息	—	—	—	27,374,006.06	27,374,006.06
资产总计	1,855,514,717.10	—	—	27,374,006.06	1,882,888,723.16
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	954,813.39	954,813.39
应付托管费	—	—	—	159,135.59	159,135.59
应付交易费用	—	—	—	13,459.25	13,459.25
其他负债	—	—	—	360,000.00	360,000.00
负债总计	—	—	—	1,487,408.23	1,487,408.23
利率敏感度缺口	1,855,514,717.10	—	—	25,886,597.83	1,881,401,314.93
上年度末2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	138,528,709.29	—	—	—	138,528,709.29
交易性金融资产	1,295,076,483.03	420,037,557.49	—	—	1,715,114,040.52
应收利息	—	—	—	25,037,565.15	25,037,565.15
资产总计	1,433,605,192.32	420,037,557.49	—	25,037,565.15	1,878,680,314.96
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	955,580.95	955,580.95
应付托管费	—	—	—	159,263.51	159,263.51
应付交易费用	—	—	—	2,267.50	2,267.50
其他负债	—	—	—	260,000.00	260,000.00



负债总计	—	—	—	1,377,111.96	1,377,111.96
利率敏感度缺口	1,433,605,192.32	420,037,557.49	—	23,660,453.19	1,877,303,203.00

注：按金融资产或金融负债的到期日或重定价日剩余期限进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	收益率曲线平行上（下）移动25个基点		
假设	除收益率曲线外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
	市场利率上升25个基点	-1,343,732.26	-3,273,619.69
	市场利率下降25个基点	1,348,772.94	3,280,667.66

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具公允价值或未来现金流量因外汇变动而发生波动的风险。本基金无涉及外汇风险的资产或负债。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币1,590,434,180.72，无属于第一层次和第三层次的余额(于2015年12月31日：第二层次为人民币1,715,114,040.52元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,590,434,180.72	84.47
	其中：债券	1,503,694,527.11	79.86
	资产支持证券	86,739,653.61	4.61
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	100,998,551.50	5.36
	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	164,081,984.88	8.71
7	其他各项资产	27,374,006.06	1.45
8	合计	1,882,888,723.16	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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买入股票。

### 8.4.2 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卖出股票。

### 8.4.3 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买入、卖出股票。

## 8.5 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	368,127,201.95	19.57
	其中：政策性金融债	368,127,201.95	19.57
4	企业债券	47,570,583.70	2.53
5	企业短期融资券	889,191,841.45	47.26
6	中期票据	198,804,900.01	10.57
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	1,503,694,527.11	79.92

## 8.6 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	160308	16进出08	1,600,000	159,466,325.48	8.48
2	011698174	16光明SCP006	1,500,000	149,847,881.64	7.96
3	011698442	16川高速 SCP004	1,500,000	149,799,948.16	7.96
4	140201	14国开01	1,400,000	140,151,586.96	7.45
5	011698830	16广州金融 SCP001	1,400,000	139,701,513.84	7.43

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1689174	16恒金2A1	1,800,000	65,918,025.18	3.50
2	1589160	15平银1A2	740,000	9,286,096.12	0.49
3	1589087	15德宝天元 1B	204,000	7,653,060.23	0.41
4	1689149	16睿程2A1	927,000	3,882,472.08	0.21

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

本基金本报告期没有投资股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	27,374,006.06
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,374,006.06

### 8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
261	7,082,086.01	1,847,999,000.0 0	99.98%	425,447.64	0.02%

### 9.2 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	5,715.87	—

### 9.3 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年6月10日)基金份额总额	1,848,424,447.64
本报告期期初基金份额总额	1,848,424,447.64
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—

本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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

2016年12月，张顺国先生担任兴业基金管理有限公司副总经理职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务，上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内没有改聘会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为8万元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为2年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人和本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	—	—	—	—	

注：注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3 亿元人民币。
- ii 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因发生重大违规行为而受到有关管理机关处罚。
- iii 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。
- iv 投研交综合实力较强。
- v 其他因素(综合能力一般，但在某些特色领域或行业，研究能力、深度和质量在行业领先)。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本期没有剔除的券商交易单元。

### 11.7.2 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
海通证券	—	—	57,000,000.00	100.00%	—	—

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴业基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-04
2	兴业基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-07
3	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、	2016-01-22



		www.cib-fund.com.cn	
4	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2015年第1号）	www.cib-fund.com.cn	2016-01-23
5	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2015年第1号）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-23
6	兴业基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-02-04
7	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2015年年度报告	www.cib-fund.com.cn	2016-03-25
8	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2016-03-25
9	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年第1次分红公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-04-19
10	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-04-21
11	兴业基金管理有限公司关于设立郑州分公司的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-05-19
12	兴业基金2016年06月30日基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-06-30
13	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-07-19
14	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2016年第1号）	www.cib-fund.com.cn	2016-07-23

15	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2016年第1号）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-07-23
16	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年半年度报告	www.cib-fund.com.cn	2016-08-24
17	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2016-08-24
18	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金2016年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-10-26
19	兴业基金管理有限公司关于设立石家庄分公司的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-11-23
20	兴业基金管理有限公司高级管理人员任职变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-08
21	兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-13
22	关于近日不法分子冒用“兴业基金”微信二维码标识的澄清公告	www.cib-fund.com.cn	2016-12-28
23	兴业基金2016年12月30日基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-30
24	兴业基金2016年12月31日基金净值（收益）	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-31

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）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
- （二）《兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金基金合同》

- (三) 《兴业稳固收益两年理财债券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

## 12.2 存放地点

除上述第（六）项文件存放于基金托管人住所外，其他备查文件等文本存放于基金管理人处，投资人在办公时间内可供免费查阅。

## 12.3 查阅方式

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  
二〇一七年三月三十一日