

兴业年年利定期开放债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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

送出日期：2015 年 8 月 26 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 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 2015 年 2 月 12 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	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 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
7.7 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	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.11 投资组合报告附注	43

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 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的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	错误！未定义书签。
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业年年利定期开放债券型证券投资基金
基金简称	兴业年年利定期开放债券
基金主代码	001019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 12 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
报告期末基金份额总额	2,780,169,957.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用定期开放、定期封闭的运作特性，通过积极主动的投资管理，在有效保持资产流动性和控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
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分析和预测，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱玮
	联系电话	021-22211888
	电子邮箱	zhuwei@cib-fund.com.cn
客户服务电话	40000-95561	95568
传真	021-22211997	010-58560798
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 2 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 2 号

邮政编码	200120	100031
法定代表人	卓新章	洪崎

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cib-fund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2015 年 2 月 12 日 – 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	59,813,093.30
本期利润	92,778,430.86
加权平均基金份额本期利润	0.0334
本期加权平均净值利润率	3.27%
本期基金份额净值增长率	3.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	59,813,093.30
期末可供分配基金份额利润	0.0215
期末基金资产净值	2,872,948,388.11
期末基金份额净值	1.033
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.30%

注：1、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。

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、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（为

期末余额，不是当期发生数)。

4、本基金于 2015 年 2 月 12 日成立。

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

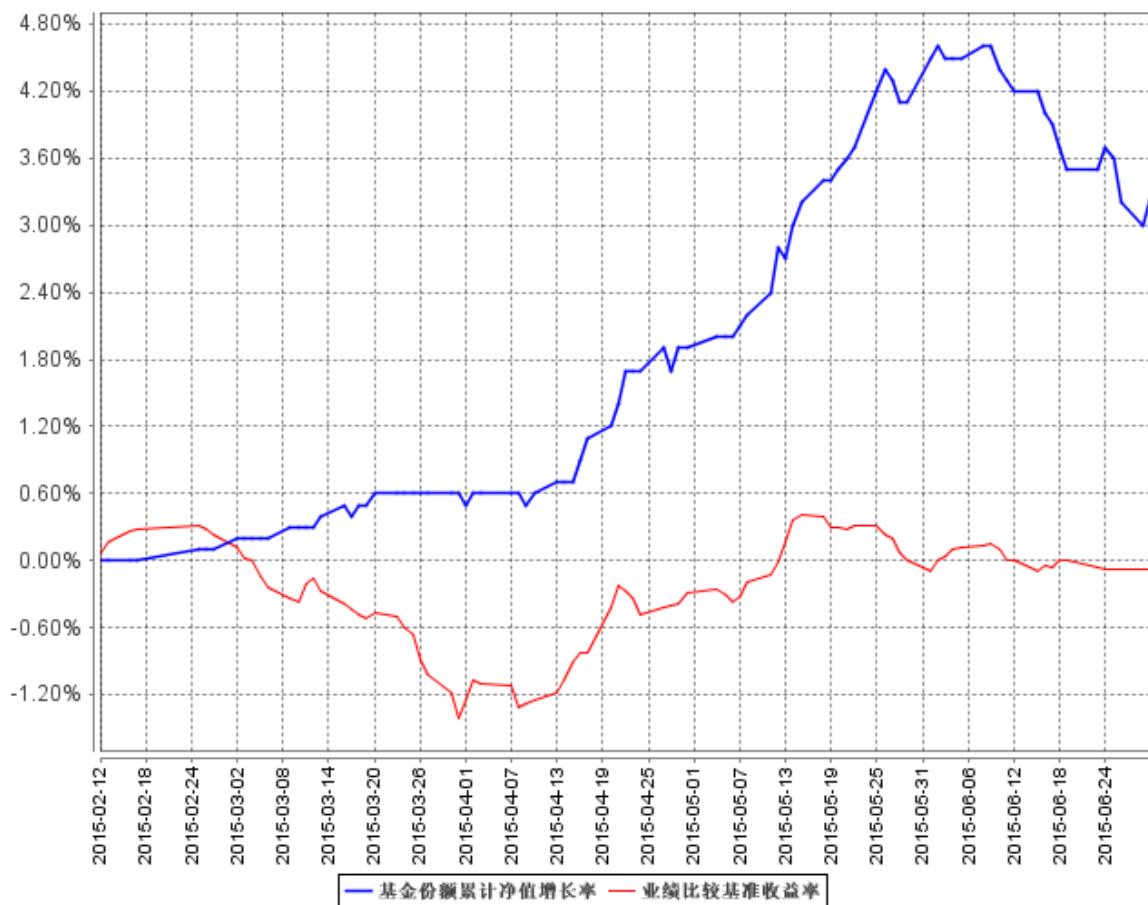
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.77%	0.18%	-0.08%	0.05%	-0.69%	0.13%
过去三个月	2.68%	0.17%	1.35%	0.10%	1.33%	0.07%
自基金合同生效起至今	3.30%	0.14%	-0.08%	0.10%	3.38%	0.04%

注：1、本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

2、本基金于 2015 年 2 月 12 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

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

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、本基金于 2015 年 2 月 12 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

2、根据《兴业年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。自 2015 年 2 月 12 日合同生效日起至本报告期末，本基金运作时间未满六个月，仍处于建仓期中。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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 5 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 2015 年 6 月 30 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、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、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、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两年理财债券投资基金、兴业添利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	本基金基金经理	2015 年 2 月 12 日	-	7	中国籍，硕士学历，CFA，具有证券投资基金管理从业资格。2008 年至 2012 年在兴业银行股份有限公司

					总行资金营运中心从事债券投资，2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司。2014年3月13日起担任兴业定期开放债券型证券投资基金基金经理，2015年2月12日起担任兴业年年利定期开放债券型证券投资基金基金经理，2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基
--	--	--	--	--	---

					金基金经理，2015 年 6 月 10 日起兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理。
周鸣	本基金的基金经理，固定收益投资总监	2015 年 2 月 12 日	-	14	中国籍，工商管理硕士，具有证券投资基金管理从业资格。先后任职于天相投资顾问有限公司、太平人寿保险公司、太平养老保险有限公司从事基金投资、企业年金投资等。2009 年加入申万菱信基金管理有限公司担任固定收益部总经理。2009 年 6 月至 2013 年 7 月担任申万菱信收益宝货币基金基金经理，2009 年 6 月至 2013 年 7 月担

					任申万菱信添益宝债券基金经理，2011 年 12 月至 2013 年 7 月担任申万菱信可转债债券基金经理。2013 年 8 月加入兴业基金管理有限公司，现任兴业基金管理有限公司固定收益投资总监、基金经理。2014 年 3 月 13 日起担任兴业定开债券基金基金经理，2015 年 2 月 12 日起担任兴业年年利定开债券基金经理，2015 年 5 月 21 日起担任兴业聚优灵活配置混合基金经理，2015 年 5 月 29 日起担任
--	--	--	--	--	---

					兴业收益 增强债券 基金基金 经理。
--	--	--	--	--	-----------------------------

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 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

受制造业生产和投资增速回落拖累，叠加房地产和基建投资偏弱、消费增长乏力等因素综合影响，一季度经济开局不利，GDP 滑落至 7%；二季度托底政策持续出台的累积效应边际显现，房地产销量持续回升、电厂耗煤量有所好转，但经济企稳力度仍弱，尤其进入 6 月以后高频数据呈现萎靡迹象，经济弱维持于 7%。总需求偏弱、大宗商品价格持续下跌，虽然二季度猪肉、水产品价格持续上涨，上半年 CPI 仍下探至 1.4%，而工业通缩压力持续加剧，PPI 同比跌幅扩大至 4.8%。外围发达经济体复苏分化、全球除美国外的主要经济体货币政策竞相宽松，美国延迟加息，美元震荡下跌；希腊违约风险继续增加，造成全球市场下跌。受经济下行压力增大、通缩压力加剧，为缓解实际利率高企、外占减少对国内流动性冲击，上半年央行进行了 3 次降准、2 次降息，并连续 3 次下调逆回购利率、3 月末出台支持“自住与改善型住房”政策，彰显政策宽松环境。资金面方面，上半年整体呈现前紧后松。受春节、资本流出、股市资金分流、新股发行加速以及央行对冲力度有限等因素影响，一季度货币市场资金面整体偏紧，R007 中枢攀升至 4.4% 高位。二季

度受经济下行压力增大，央行持续通过公开市场操作、降息、降准、MLF、PSL 等价格和数量工具为市场提供了宽松的流动性，货币市场资金面整体偏松，二季度 R007 中枢下跌至 2.49%，为近四年同期最低。

总体看，上半年利率债走出了“W”震荡形态，利率债的波动幅度相对显著，收益率曲线陡峭化调整，信用利差总体收窄至历史低位。一季度在疲软经济数据和强烈宽松预期下，债券利率先于货币政策放松和资金利率下降而迅速走低，10 年国债和 10 年国开债最低分别达到 3.33% 和 3.66% 的低点；降息后资金利率下行并不明显，交易盘获利回吐压力增大，叠加地方政府债务供给担忧和 330 房地产新政出台后对经济企稳的担忧，债券收益率显著反弹。随着一季度经济数据低于预期、金融数据再度疲软影响，地方债务承接方式多样化，同时 4 月央行再次降准，释放超万亿资金，资金价格显著下行，带动收益率再度下行；伴随房地产景气持续改善、托底政策密集出台，经济企稳预期升温，第二波地方债务置换再度来袭，收益率再度反弹；6 月多空对峙，收益率区间震荡。总体上，信用债整体表现好于利率债，各券种均有所下行，短端及高评级债券更为显著，130-150BP 下行，中端下行 60-80BP，长端下行 20-40BP；利率债短端下行 120-150BP，中端下行 20-50BP，长端下行 5BP 以内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金今年成立以来至 2015 年 6 月 30 日净值增长率为 3.30%，同期业绩比较基准收益率为 -0.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济因基数效应弱反弹，通胀将温和回升，稳增长和控风险均要求宽松政策延续。三、四季度经济大概率弱维持 7% 附近，主要力量来自：工业领域缓慢出清下的再平衡，跌幅或将趋缓；自去年四季度以来，地产小周期企稳并有望维持至年末或明年一季度；财政政策仍有空间以及地方政府筹融资环境边际改善均有利于基建投资的阶段性回升。通胀将在三季度温和回升，在货币增速受控叠加总需求偏弱的背景下，通胀将继续维持低位，年内 CPI 和 PPI 面临的最大不确定性因素将分别是猪价和大宗商品价格。尽管猪价在供给低位下有潜在的上涨压力，但需求不振抑制涨幅，难以对通胀构成明显冲击；在缺乏需求支撑的背景下，大宗价格波动更多取决于美元指数的波动，我们判断美元将持续维持强势，但大幅升值的空间有限。因此，在没有其他意外因素的干扰下，下半年 CPI 回升的概率较大，但超过 3% 的可能性依然不高，对货币政策及债市尚不构成压力。政策重在托底和控风险，强力“放水”概率不大。当前实际利率依然维持高位，

综合考虑下半年通胀将逐步回升带动实际利率下行、美国潜在加息的可能均制约降息的空间；降准空间相对较大，以对冲外汇占款减少带来的基础货币缺口以及地方债务置换的资金需求，资金面维持低位或为常态。

债券市场或存阶段性交易机会，把握套息价值机会。目前债市收益率的特征是：绝对收益率水平处于均值略低水平、收益率曲线相对陡峭以及信用利差收窄至历史相对低位。综合考虑目前降低社会融资成本的核心任务、地方债务的顺利置换以及经济整体偏弱的现实，货币政策大概率将持续维持相对宽松态势，资金价格绝对水平或将持续维持相对低位，这或许意味着套息收益仍相对可得，中长期利率大幅调整的概率不大。利率债震荡区间上沿可适度参与，而下行至区间下沿则不可强追，继续维持“快进快出”操作节奏。利率风险偏小叠加股市暴跌、政府“救市”以及IPO暂停或将给债市带来部分增量资金，信用债是直接受益者。具体品种上，城投债供给短期内仍难以显著增加，企业债的绝对收益率以及期限利差等处于较低水平，综合考虑纳入政府债务概率、当地财政及平台自身实力等因素，在品种上优先配置纳入政府债务概率较大，当地财政及平台自身实力相对较强的品种；产业债则重点配置受益于降息的基建领域、房地产及其上游钢铁、水泥、铝行业等优质企业。

在权益类市场波动加剧的背景下，短期债市仍处慢牛阶段，但中长期最终还是取决于经济基本面。操作上，本基金总体继续维持中等久期、适度杠杆的操作风格，但短期应顺势而为；品种上，以平均配置为主，精挑细选城投债以及行业景气度逐步改善的周期性行业公司债，以获取超额收益，风险上，对信用风险高度关注，谨慎配置。

4.6 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

估值委员会由公司分管估值业务的领导、基金运营部负责人、研究部负责人、风险管理总部负责人、监察稽核部负责人、投资管理总部负责人组成。均具有丰富的证券研究、会计核算、风控、合规等证券基金行业从业经验及专业能力。除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；不定期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的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用；评价现有估值方法对新投资策略或投资新品种的适用性，对新投资策略或投资新品种采用的估值方法作出决定。

（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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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

报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§ 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

2015 年上半年，基金托管人在兴业年年利定期开放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

2015 年上半年，兴业基金管理有限公司在兴业年年利定期开放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。

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

2015 年上半年，由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业年年利定期开放债券型证券投资基金的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：兴业年年利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日： 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	13,872,874.53
结算备付金		755,630.19
存出保证金		210,289.09
交易性金融资产	6.4.7.2	3,841,154,701.86
其中：股票投资		198,800.00
基金投资		—
债券投资		3,755,370,710.08
资产支持证券投资		85,585,191.78
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		14,729,171.37
应收利息	6.4.7.5	63,160,230.98
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		3,933,882,898.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
负债：		
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		1,057,668,070.55
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,663,312.94
应付托管费		427,709.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	29,801.72
应交税费		-
应付利息		977,781.51
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	167,834.16
负债合计		1,060,934,509.91
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	2,780,169,957.25
未分配利润	6.4.7.10	92,778,430.86
所有者权益合计		2,872,948,388.11
负债和所有者权益总计		3,933,882,898.02

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.033 元，基金份额总额 2,780,169,957.25 份。

2、本基金 2015 年 2 月 12 日成立，本期数据按照实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：兴业年年利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 2 月 12 日(基金合同生 效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		107,974,312.86
1.利息收入		69,187,996.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,027,860.96
债券利息收入		50,805,412.05
资产支持证券利息收入		3,354,723.30
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		5,820,978.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,810.67
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	6,334,371.06
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-516,202.74

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	32,965,337.56
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	-
减: 二、费用		15,195,882.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,494,816.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,927,238.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,882.05
5. 利息支出		5,576,807.26
其中: 卖出回购金融资产支出		5,576,807.26
6. 其他费用	6.4.7.20	180,137.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		92,778,430.86
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		92,778,430.86

注: 本基金 2015 年 2 月 12 日成立, 本期数据按照实际存续期计算, 无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 兴业年年利定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)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)	2,780,169,957.25	-	2,780,169,957.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	92,778,430.86	92,778,430.86
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)	2,780,169,957.25	92,778,430.86	2,872,948,388.11
-----------------	------------------	---------------	------------------

注：本基金 2015 年 2 月 12 日成立，本期数据按照实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业年年利定期开放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》、《兴业年年利定期开放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[2014]1245 号文批准公开募集。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 2,780,169,957.25 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 0138 号验资报告。基金合同于 2015 年 2 月 12 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业年年利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》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，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、集合债券、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金融工具，但须符合中国证监会相关规定。因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证，应当在其可上市交易后的 10 个交易日内卖出。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。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%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前 3 个月至开放期结束后 3 个月内不受前述比例限制。开放期内，基金持有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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

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于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于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的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间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

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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。

(2) 金融负债的分类

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。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 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：(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(2)对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(3)当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

4)对于交易所市场和银行间市场交易的主要固定收益品种，采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值，另有规定除外。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

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

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为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。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个

人所得税后的净额确认。

- 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 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 $\times 0.70\%$ 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 $\times 0.18\%$ 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 3) 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；
- 4) 每一基金份额享有同等分配权；
- 5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期所采用的会计估计发生变更。

会计估计变更主要内容为：根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“《估值处理标准》”）的有关规定，经与相关托管银行、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 25 日起，对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种主要采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，《估值处理标准》另有规定的除外。于 2015 年 3 月 25 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

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管理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[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》、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》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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》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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税；对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税，暂不征收企业所得税。

- 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。
- 5) 对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。
- 6) 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、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	13,872,874.53
定期存款	—
其中: 存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计:	13,872,874.53

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	186,400.00	198,800.00	12,400.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	1,646,144,374.50	1,664,949,710.08
	银行间市场	2,076,273,398.02	2,090,421,000.00
	合计	3,722,417,772.52	3,755,370,710.08
资产支持证券	85,585,191.78	85,585,191.78	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	3,808,189,364.30	3,841,154,701.86	32,965,337.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18, 548. 22
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	340. 00
应收债券利息	61, 502, 508. 42
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1, 638, 834. 34
合计	63, 160, 230. 98

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	57. 74
银行间市场应付交易费用	29, 743. 98
合计	29, 801. 72

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—

预提费用	167,834.16
合计	167,834.16

6.4.7.9 实收基金

单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,780,169,957.25	2,780,169,957.25
本期申购	—	—
本期赎回(以"-"号填列)	—	—
本期末	2,780,169,957.25	2,780,169,957.25

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,779,332,083.32 元，折合 2,779,332,083.32 份基金份额。募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币 837,873.93 元，折合 837,873.93 份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币 2,780,169,957.25 元，折合 2,780,169,957.25 份基金份额。

3、本基金基金合同生效后至本报告期末处于封闭期，因此未发生申购赎回。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	59,813,093.30	32,965,337.56	92,778,430.86
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	—	—	—
本期末	59,813,093.30	32,965,337.56	92,778,430.86

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		1,325,955.06
定期存款利息收入		13,690,694.44

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,311.65
其他	899.81
合计	15,027,860.96

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
卖出股票成交总额	140,681.43
减：卖出股票成本总额	137,870.76
买卖股票差价收入	2,810.67

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年 6月30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	6,334,371.06
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	6,334,371.06

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	114,836,950.85
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	107,647,371.72
减：应收利息总额	855,208.07
买卖债券差价收入	6,334,371.06

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年 6月30日
卖出资产支持证券成交总额	42,272,000.00
减： 卖出资产支持证券成本总额	40,516,202.74
减： 应收利息总额	2,272,000.00
资产支持证券投资收益	-516,202.74

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
1. 交易性金融资产	32,965,337.56
——股票投资	12,400.00
——债券投资	32,952,937.56
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—

3. 其他	-
合计	32,965,337.56

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,007.05
银行间市场交易费用	12,875.00
合计	16,882.05

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	38,730.96
信息披露费	129,103.20
银行费用	11,903.50
开户费	400.00
合计	180,137.66

6.4.7.21 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
兴业基金管理有限公司(以下简称“兴业基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 12 日(基金合同生 效日)至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,494,816.51
其中：支付销售机构的客户维护费	1,003,813.71

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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 \times 0.70% / 当年天数。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日(基金合同生效 日)至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付 的托管费	1,927,238.52	-

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.18%的年费率计提。计算方法如下：

日基金托管费=前一日基金资产净值 \times 0.18% /当年天数。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

注：本基金本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年6月30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	-	3,205,000.00
中国民生银行股份有限公司	13,872,874.53	7,974,843.95

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金本报告期存放于兴业银行股份有限公司的协议存款按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于 2015 年 3 月 3 日购入民生转债(110023)，数量 2,820.00 张。本基金于 2015 年 6 月 23 日执行债转股，获取民生银行(600016)，数量 34,793.00 股。本基金于 2015 年 6 月 29 日出售民

生银行(600016),数量 14,793.00 股;于 2015 年 7 月 2 日出售民生银行(600016),数量 20,000.00 股。

。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.2 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
122371	14 亨通 01	2015 年 6 月 25 日	2015 年 7 月 30 日	认购新发债券	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00	-
112249	15 博彦债	2015 年 5 月 27 日	2015 年 7 月 29 日	认购新发债券	100.00	100.00	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	-
112253	15 荣盛 01	2015 年 6 月 26 日	2015 年 7 月 23 日	认购新发债券	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-
117531	山证 1503	2015 年 6 月 12 日	2015 年 8 月 18 日	认购新发债券	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期内未持有需披露的暂时停牌股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 859,697,110.45 元，是以如下债券作为质押：

单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单	数量(张)	期末估值总额

			价		
011599109	15 武港务 SCP001	2015 年 7 月 6 日	100.67	200,000	20,134,000.00
011599231	15 昆山经 技 SCP006	2015 年 7 月 6 日	100.19	300,000	30,057,000.00
101555002	15 绿城水 务 MTN001	2015 年 7 月 6 日	101.32	400,000	40,528,000.00
101559010	15 港九 MTN001	2015 年 7 月 6 日	101.65	200,000	20,330,000.00
101565001	15 中山兴 中 MTN001	2015 年 7 月 6 日	101.05	400,000	40,420,000.00
011599041	15 昆钢 SCP001	2015 年 7 月 6 日	100.87	500,000	50,435,000.00
101551005	15 华数 MTN001	2015 年 7 月 6 日	101.05	300,000	30,315,000.00
011599085	15 宏图 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.73	600,000	60,438,000.00
011599104	15 深茂业 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.71	700,000	70,497,000.00
011599160	15 红豆 SCP003	2015 年 7 月 1 日	100.71	400,000	40,284,000.00
011599205	15 广田 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.23	400,000	40,092,000.00
041562003	15 沪世茂 CP001	2015 年 7 月 1 日	100.94	500,000	50,470,000.00
101574002	15 沪世茂 MTN001	2015 年 7 月 1 日	101.38	600,000	60,828,000.00
011599089	15 山钢 SCP002	2015 年 7 月 1 日	100.81	500,000	50,405,000.00
011599106	15 天业 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.78	500,000	50,390,000.00
1380190	13 泰达建 设债	2015 年 7 月 3 日	103.12	500,000	51,560,000.00
1380081	13 融国投 债	2015 年 7 月 3 日	103.45	200,000	20,690,000.00
1480335	14 孝城投 债	2015 年 7 月 3 日	104.22	200,000	20,844,000.00
101555003	15 均瑶 MTN001	2015 年 7 月 3 日	102.62	400,000	41,048,000.00
041560015	15 永泰能 源 CP001	2015 年 7 月 3 日	101.08	800,000	80,864,000.00
合计				8,600,000	870,629,000.00

6.4.12.3.2 交易场所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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人民币 197,970,960.10 元，于 2015 年 7 月 21 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、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分析和预测，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，力求规避风险并实现基金资产的保值增值。

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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

面的研究、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。

6.4.13.2 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种种原因，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发行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。

6.4.13.2.1 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	765,725,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	573,554,000.00	-
合计	1,339,279,000.00	-

注：未评级债券为超短期融资券

6.4.13.2.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	127,919,341.86	-
AAA 以下	2,017,219,560.00	-
未评级	356,538,000.00	-
合计	2,501,676,901.86	-

注：未评级的债券为国债、央行票据及政策性金融债。

6.4.13.3 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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本报告期内基金的资产均能及时变现。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个 月以 内	1-3 个 月	3 个 月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产								
银行存款	-	-	-	13,872,874.53	-	-	-	13,872,874.53
结算备付金	-	-	-	755,630.19	-	-	-	755,630.19
存出保证金	-	-	-	210,289.09	-	-	-	210,289.09
交易性金融 资产	-	-	-	1,535,005,985.93	1,483,536,943.93	822,412,972.00	198,800.00	3,841,154,701.86
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-14,729,171.37	14,729,171.37
应收利息	-	-	-	-	-	-	-63,160,230.98	63,160,230.98
资产总计	-	-	-	1,549,844,779.74	1,483,536,943.93	822,412,972.00	78,088,202.35	3,933,882,898.02
负债								
卖出回购金 融资产款	-	-	-	1,057,668,070.55	-	-	-	1,057,668,070.55
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	-	1,663,312.94	1,663,312.94
应付托管费	-	-	-	-	-	-	427,709.03	427,709.03
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	29,801.72	29,801.72
应付利息	-	-	-	-	-	-	977,781.51	977,781.51
其他负债	-	-	-	-	-	-	167,834.16	167,834.16
负债总计	-	-	-	1,057,668,070.55	-	-	3,266,439.36	1,060,934,509.91
利率敏感度 缺口	-	-	-	492,176,709.19	1,483,536,943.93	822,412,972.00	74,821,762.99	2,872,948,388.11
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个 月以 内	1-3 个 月	3 个 月-1 年	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产								
负债								

注：按金融资产或金融负债的到期日进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 25 个基点	16,537,674.10	-
	市场利率上升 25 个基点	-16,374,714.86	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	198,800.00	0.01	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,841,154,701.86	133.70	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除市场利率以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 (2015 年 6 月 30 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 个基点	9,940.00	-
	市场利率上升 25 个基点	-9,940.00	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

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	198,800.00	0.01
	其中: 股票	198,800.00	0.01
2	固定收益投资	3,840,955,901.86	97.64
	其中: 债券	3,755,370,710.08	95.46
	资产支持证券	85,585,191.78	2.18
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	14,628,504.72	0.37
7	其他各项资产	78,099,691.44	1.99
8	合计	3,933,882,898.02	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

单位: 人民币元

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	-	-

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	198,800.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	198,800.00	0.01

7.3 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

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	20,000	198,800.00	0.01

注：上述个股是由可转债转股获得，将按照合同约定在 10 个交易日内卖出。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	324,270.76	0.01

注：上述个股是由可转债转股获得。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	140,681.43	0.00

注：上述个股是由可转债转股获得。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	324,270.76
卖出股票收入（成交）总额	140,681.43

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	1,887,359,964.48	65.69
5	企业短期融资券	1,339,279,000.00	46.62
6	中期票据	470,375,000.00	16.37
7	可转债	58,356,745.60	2.03
8	其他	—	—
9	合计	3,755,370,710.08	130.71

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

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	041560015	15 永泰能源 CP001	1,000,000	101,080,000.00	3.52
2	123254	15 华福 01	900,000	92,790,000.00	3.23
3	101574002	15 沪世茂 MTN001	800,000	81,104,000.00	2.82

4	123237	15 民生 01	800,000	80,200,000.00	2.79
5	124916	14 新开元	700,000	72,800,000.00	2.53

7.7 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

单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123510	14 吉城 04	500,000	50,754,979.45	1.77
2	123588	禾燃气 02	100,000	10,000,000.00	0.35
2	123587	禾燃气 01	100,000	10,000,000.00	0.35
3	119025	侨城 03	100,000	9,824,369.86	0.34
4	119109	徐新盛 01	50,000	5,005,842.47	0.17

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

注：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

注：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

-根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.10.3 本期国债期货投资评价

-根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	210,289.09
2	应收证券清算款	14,729,171.37
3	应收股利	—
4	应收利息	63,160,230.98
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	78,099,691.44

7.11.4 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	113501	洛钼转债	10,414,773.60	0.36

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

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

20,129	138,117.64	996,105.94	0.04%	2,779,173,851.31	99.96%
--------	------------	------------	-------	------------------	--------

8.2 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	19,880.72	0.0007%

8.3 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
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(2015年2月12日)基金份额总额	2,780,169,957.25
本报告期期初基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
本报告期期末基金份额总额	2,780,169,957.25

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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

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	
方正证券	2	140,681.43	100.00%	57.74	100.00%	-

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

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
方正证券	1,473,729,981.36	100.00%	1,116,006,000.00	100.00%	-	-

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 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
 - ii 公司财务状况良好。
 - iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
 - iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
 - v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。
- 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在上述租用的券商交易单元中，方正证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

10.8 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	兴业年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站	2015年2月13日
2	兴业基金兴业宝业务升级暂停交易的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015年2月26日
3	兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015年3月26日
4	兴业基金管理有限公司关于通过直销柜台办理基金申购业务费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015年3月26日
5	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015年4月11日
6	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015年4月15日
7	兴业基金管理有限公司关于参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015年4月15日

8	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业银行费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 4 月 17 日
9	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金通过网上直销系统认购、申购、赎回数量限制的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
10	兴业基金管理有限公司关于网上直销系统上线并开展基金销售费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
11	兴业基金管理有限公司关于网上直销系统开通通联支付渠道的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日
12	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
13	兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 5 月 23 日
14	兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
15	兴业基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 6 月 27 日
16	兴业基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加交通银行为销售机构及旗下所有基金参加交通银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日
17	兴业基金 2015 年 6 月 30 日基金净值（收益）	中国证券报、基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予兴业年年利定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业年年利定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业年年利定期开放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

11.2 存放地点

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

11.3 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。

客户服务电话: 4000095561

兴业基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日