

兴业保本混合型证券投资基金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2月3日(基金合同生效日)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	11
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	14
§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	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6	审计报告	15
6.1	审计报告基本信息	15
6.2	审计报告的基本内容	15
§7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4	报表附注	21
§8	投资组合报告	43
8.1	期末基金资产组合情况	43
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	44
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	45
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12	投资组合报告附注	49
§9	基金份额持有人信息	50
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

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	50
§10 开放式基金份额变动	50
§11 重大事件揭示	51
11.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	52
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业保本混合型证券投资基金
基金简称	兴业保本混合
基金主代码	002338
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3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	1,260,373,522.05
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险（CPPI，Constant Proportion Portfolio Insurance）策略动态调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例，以实现保本和增值的目标。
业绩比较基准	三年期银行人民币定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种。其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

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	姓名	朱玮	王永民
	联系电话	021-22211888	010-66594896

人	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的办公场所

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
基金保证人	北京首创融资担保有限公司	北京市西城区闹市口大街1号院长安兴融中心4号楼3层03B-03G

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	2016年2月3日（基金合同生效日）-2016年12月31日
本期已实现收益	49,670,249.77
本期利润	38,268,686.12
加权平均基金份额本期利润	0.0277
本期加权平均净值利润率	2.72%
本期基金份额净值增长率	2.70%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配利润	33,599,803.86
期末可供分配基金份额利润	0.0267
期末基金资产净值	1,293,973,325.91
期末基金份额净值	1.027
3.1.3 累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	2.70%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金于2016年2月3日成立，截至本报告期末，本基金成立未满一年。

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

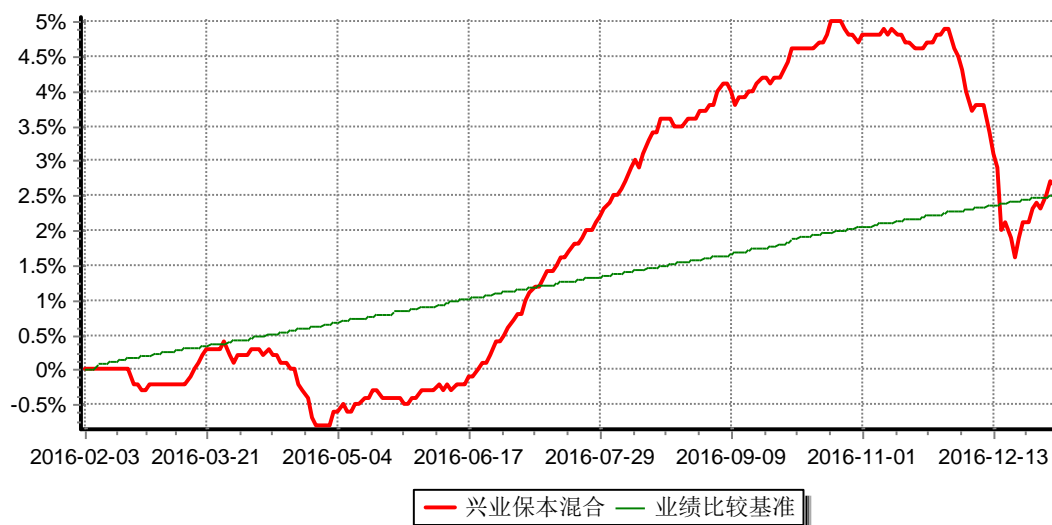
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.63%	0.18%	0.68%	0.01%	-2.31%	0.17%
过去六个月	2.09%	0.14%	1.37%	0.01%	0.72%	0.13%
自基金合同生效日起至今	2.70%	0.12%	2.51%	0.01%	0.19%	0.11%

注：1、本基金基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期。

2、本基金的业绩比较基准为：三年期银行人民币定期存款税后收益率。

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

兴业保本混合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

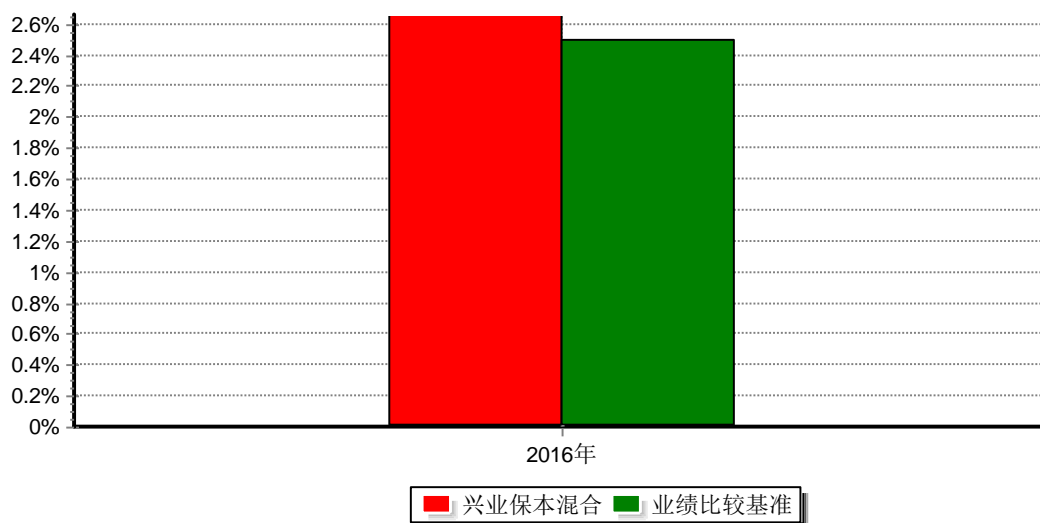


注：1、本基金合同于2016年2月3日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、根据本基金基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

兴业保本混合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2016年2月3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

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
丁进	本基金的基金经理	2016年2月3日	—	6	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2005年7月至2008年2月，在北京顺泽锋投资咨询有限公司担任研究员；2008年3月至2010年10月，在新华信国际信息咨询（北京）有限公司担任企业信用研究高级咨询顾问；2010年10月至2012年8月，在光大证券研究所担任信用及转债研究员；2012年8月至2015年2月就职于浦银安盛基金管理有限公司，其中2012年8月至2015年2月担任浦银安盛增利分级债券型证券投资基金的基金经理助理，2012年9月至2015年2月担任浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2013年5月至2015

					<p>年2月担任浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，2013年6月至2015年2月担任浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2015年2月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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年在稳增长政策指导下，经济总体稳中有进，经济运行出现积极变化，投资增速在基建、房地产投资超预期拉动下小幅提振，制造业投资与消费保持较弱势，四季度开始政府对于房地产调控力度加大，全球经济增速小幅回升也带动了宽松预期减弱，美元走强使得人民币汇率出现大幅波动；国内货币政策中性偏紧，利率中枢大幅上移。2016年债市总体呈现先扬后抑走势，年末在内外因素影响下，债市短期调整幅度创历史纪录，全年债券收益小幅增长。

权益市场受到熔断政策影响，全年先抑后扬，蓝筹和创业板成长股分化明显，最终上证指数下跌12.3%。

组合整体上以配置保本周期附近的中高评级信用债为主，权益方面，在安全垫范围内配置部分蓝筹个股，主要覆盖家电、汽车、环保、保险等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，自成立以来，本基金份额净值增长率为2.70%，同期业绩比较基准收益率为2.51%。

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，经济通胀等基本面因素保持相对平稳，债券收益率显著上行的基础偏弱。在弱补库存周期、出口的边际改善以及基建投资托底等正面因素和以地产投资减弱、制造业投资偏弱以及消费总体偏弱的负向力量共同作用下，实际GDP大概率围绕6.5%上下小幅波动，节奏上看，全年或呈现前高后低的走势；总需求稳中趋弱、房价下行压力增大、资源资产价格上行的幅度和持续性受制因素增多、PPI向CPI传导受限等因素作用下，通胀中枢有望维持在2.1%-2.3%之间。2017年的不确定因素之一来自外围，关键在于特朗普执政团队对美国发展及对中国的政策。政策不确定性与预期差可能带来交易机会。流动性或总体保持中性偏紧，债市供需关系弱化，叠加监管趋严，驱使金融市场定价修复，回归基本面。监管力度的覆盖广度与深度，是2017年的另一重要不确定因素之一。去杠杆背景下关注高等级信用债和利率债的投资机会。权益市场方面，基建投资力度将加大，以填补房地产调控下相关投资的减少。对于环保问题的重视，以及科技创新对于消费升级的影响等主题均受益相关板块。保本产品在监管新规下改名为避险策略产品，未来运作在法规上将更加谨慎，防范权益投资部分导致的净值大幅回撤风险。

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

根据《基金合同》本基金

1、保本周期内的收益分配

(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，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的60%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 在符合上述第(1)项约定收益分配次数和比例的前提下，当本基金自最近一次分红除息日以来（若尚未分红，则自基金合同生效日以来）的份额累计净值增长率达到或超过5%，或者每份基金份额可供分配利润达到或超过0.05元时，本基金管理人应在接下来的15个工作日内进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

2、转型为非保本的混合型基金后的收益分配

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；

(2) 基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，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收益分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期未进行利润分配。

本基金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”）在兴业保本混合型证券投资基金（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P01220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	兴业保本混合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保本混合型证券投资基金

	<p>(以下简称"兴业保本混合")的财务报表, 包括2016年12月31日的资产负债表, 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p>
<p>管理层对财务报表的责任段</p>	<p>编制和公允列报财务报表是兴业保本混合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。</p>
<p>注册会计师的责任段</p>	<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> <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。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为, 兴业保本混合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, 公允反映了兴业保本混合2016年12月31日的财务状</p>

	况以及2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间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：兴业保本混合型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,617,626.89
结算备付金		9,427,306.51
存出保证金		61,652.44
交易性金融资产	7.4.7.2	1,580,867,163.08
其中：股票投资		69,216,965.68
基金投资		—
债券投资		1,511,650,197.40
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		7,526,466.34
应收利息	7.4.7.5	30,188,246.41
应收股利		—
应收申购款		4,271.34

递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		1,631,692,733.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日
负 债:		
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		333,599,445.00
应付证券清算款		65,909.23
应付赎回款		1,937,455.50
应付管理人报酬		1,346,571.24
应付托管费		224,428.52
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	102,758.07
应交税费		—
应付利息		33,308.47
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	409,531.07
负债合计		337,719,407.10
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	1,260,373,522.05
未分配利润	7.4.7.10	33,599,803.86
所有者权益合计		1,293,973,325.91
负债和所有者权益总计		1,631,692,733.01

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.027元，基金份额总额1,260,373,522.05份。

2、本基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体：兴业保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
一、收入		60,750,499.09
1.利息收入		47,517,089.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,596,385.76
债券利息收入		43,435,628.60
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		1,485,074.92
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,214,188.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,384,849.34
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	9,111,682.16
资产支持证券投资收益		—
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	717,657.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-11,401,563.65
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	1,420,784.96

减：二、费用		22,481,812.97
1. 管理人报酬		15,347,423.16
2. 托管费		2,557,903.83
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.18	321,069.41
5. 利息支出		3,810,118.11
其中：卖出回购金融资产支出		3,810,118.11
6. 其他费用	7.4.7.19	445,298.46
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		38,268,686.12
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		38,268,686.12

注：本基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016年2月3日（基金合同生效日）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)	1,446,447,428.88	—	1,446,447,428.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	38,268,686.12	38,268,686.12
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)	-186,073,906.83	-4,668,882.26	-190,742,789.09
其中：1.基金申购款	9,538,397.06	262,797.00	9,801,194.06
2.基金赎回款	-195,612,303.8	-4,931,679.26	-200,543,983.15

	9		
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)	1,260,373,522.0 5	33,599,803.86	1,293,973,325.91

注：本基金合同于2016年2月3日生效，本报告期不是完整报告期，本期数据按实际存续期计算，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7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

卓新章

黄文锋

夏鹏

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

兴业保本混合型证券投资基金(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》、《兴业保本混合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]2981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1,446,447,428.88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(16)第0076号验资报告。基金合同于2016年2月3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》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业保本混合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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债券、地方政府债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、债券回购等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以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的相关规定)。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。基金的投资组合比例为：股票、权证、股指期货等权益类资产的净头寸占基金资产的比例不高于40%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比

例不低于60%，其中基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金参与股指期货，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。本基金的业绩比较基准为：三年期银行人民币定期存款税后收益率。

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2月3日(合同生效日)至2016年12月31日止期间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

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。本财务报表的实际编制期间为2016年2月3日(基金合同生效日)至2016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

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。

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

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。

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：

1)对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但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。

3)对存在活跃市场的其他投资品种，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。

4)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。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

1) 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。

2) 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。

3) 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。

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的1.2%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的0.2%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) 保本周期内的收益分配

(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，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的60%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2)在符合上述第(1)项约定收益分配次数和比例的前提下，当本基金自最近一次分红除息日以来(若尚未分红，则自基金合同生效日以来)的份额累计净值增长率达到或超过5%，或者每份基金份额可供分配利润达到或超过0.05元时，本基金管理人应在接下来

的15个工作日内进行收益分配；

(3)本基金收益分配方式仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；

2)转型为非保本的混合型基金后的收益分配

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；

(2)基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，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。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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《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[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。

4)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；个人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年的股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

5)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)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。

7)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。

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
活期存款	3,617,626.89
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—

其他存款	—
合计	3,617,626.89

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		67,990,681.95	69,216,965.68	1,226,283.73
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	535,694,605.00	530,903,397.40	-4,791,207.60
	银行间市场	988,583,439.78	980,746,800.00	-7,836,639.78
	合计	1,524,278,044.78	1,511,650,197.40	-12,627,847.38
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,592,268,726.73	1,580,867,163.08	-11,401,563.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

应收活期存款利息	1,962.81
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	4,666.53
应收债券利息	30,181,586.60
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	30.47
合计	30,188,246.41

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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
交易所市场应付交易费用	95,540.08
银行间市场应付交易费用	7,217.99
合计	102,758.07

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	29,531.07
预提费用	380,000.00
合计	409,531.07

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,446,447,428.88	1,446,447,428.88
本期申购	9,538,397.06	9,538,397.06
本期赎回（以“-”号填列）	-195,612,303.89	-195,612,303.89
本期末	1,260,373,522.05	1,260,373,522.05

注：1、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；

2、本基金合同于2016年2月3日生效。首次设立募集基金金额为1,445,940,903.47元，折合1,445,940,903.47份基金份额。募集资金在募集期间产生的活期利息为506,525.41元，折合506,525.41份基金份额。以上收到的实收基金（本息）共计人民币1,446,447,428.88元，折合1,446,447,428.88份基金份额。

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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	49,670,249.77	-11,401,563.65	38,268,686.12
本期基金份额交易产生的变动数	-4,074,972.73	-593,909.53	-4,668,882.26
其中：基金申购款	171,985.54	90,811.46	262,797.00
基金赎回款	-4,246,958.27	-684,720.99	-4,931,679.26
本期已分配利润	—	—	—
本期末	45,595,277.04	-11,995,473.18	33,599,803.86

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
活期存款利息收入	427,677.08
定期存款利息收入	1,974,983.34

其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	191,785.84
其他	1,939.50
合计	2,596,385.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出股票成交总额	96,201,387.19
减：卖出股票成本总额	82,816,537.85
买卖股票差价收入	13,384,849.34

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2月3日（基金合同生效日）至2016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	9,111,682.16
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	9,111,682.16

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2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到	864,773,371.08

期兑付)成交总额	
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	839,174,142.80
减:应收利息总额	16,487,546.12
买卖债券差价收入	9,111,682.16

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期间无衍生工具收益。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位:人民币元

项目	本期
	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	717,657.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	717,657.00

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目	本期
	2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-11,401,563.65
——股票投资	1,226,283.73
——债券投资	-12,627,847.38
——资产支持证券投资	—

——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-11,401,563.65

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,420,784.96
合计	1,420,784.96

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
交易所市场交易费用	306,394.41
银行间市场交易费用	14,675.00
合计	321,069.41

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	300,000.00
开户费	400.00
帐户维护费	18,600.00

汇划手续费	46,298.46
合计	445,298.46

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

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。

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、基金注册登记机构
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	基金托管人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人的子公司

注：上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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,347,423.16
其中：支付销售机构的客户维护费	5,817,080.42

注：1、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1.2%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×1.2%÷当年天数；

2、本基金于2016年2月3日成立，不存在上年度可比期间。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,557,903.83

注：1、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0.2%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×0.2%÷当年天数；

2、本基金于2016年2月3日成立，不存在上年度可比期间。

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。

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

本基金本报告期内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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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2月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,617,626.89	820,493.75

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业或协议利率计算；

2、本基金于2016年2月3日成立，不存在上年度可比期间。

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

本基金本报告期无须说明的其他关联方交易事项。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	

300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	

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

截至本报告期末2016年12月31日止，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49,999,445.00元，是以如下债券作为质押：

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
041663004	16首钢CP002	2017-01-05	100.17	100,000	10,017,000.00
041663004	16首钢CP002	2017-01-03	100.17	200,000	20,034,000.00
140205	14国开05	2017-01-05	112.63	200,000	22,526,000.00
合计				500,000	52,577,000.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额283,600,000.00元，于2017年1月3日到期。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。

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

本基金投资的金融工具主要为股票及债券等。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，为投资人提供投资金额安全的保证，并在此基础上力争基金资产的稳定增值，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中低风险的基金品种，其风险收益预

期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金和非保本的混合型基金。

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
A-1	270,594,000.00
A-1以下	—
未评级	169,532,000.00
合计	440,126,000.00

7.4.13.2.2 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 2016年12月31日
AAA	241,570,070.00
AAA以下	555,628,127.40
未评级	—
合计	797,198,197.40

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。

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	3,617,626.89	—	—	—	3,617,626.89
结算备付金	9,427,306.51	—	—	—	9,427,306.51
存出保证金	61,652.44	—	—	—	61,652.44
交易性金融资产	847,179,391.20	401,316,806.20	263,154,000.00	69,216,965.68	1,580,867,163.08
应收证券清算款	—	—	—	7,526,466.34	7,526,466.34
应收利息	—	—	—	30,188,246.41	30,188,246.41
应收申购款	—	—	—	4,271.34	4,271.34
资产总计	860,285,977.04	401,316,806.20	263,154,000.00	106,935,949.77	1,631,692,733.01
负债					
卖出回购金融资产款	333,599,445.00	—	—	—	333,599,445.00
应付证券清算款	—	—	—	65,909.23	65,909.23
应付赎回款	—	—	—	1,937,455.50	1,937,455.50
应付管理人报酬	—	—	—	1,346,571.24	1,346,571.24
应付托管费	—	—	—	224,428.52	224,428.52
应付交易费用	—	—	—	102,758.07	102,758.07
应付利息	—	—	—	33,308.47	33,308.47

其他负债	—	—	—	409,531.07	409,531.07
负债总计	333,599,445.00	—	—	4,119,962.10	337,719,407.10
利率敏感度缺口	526,686,532.04	401,316,806.20	263,154,000.00	102,815,987.67	1,293,973,325.91

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 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	
假设	利率曲线平行移动	
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
	市场利率下降25个基点	9,607,094.28
	市场利率上升25个基点	-9,479,631.35

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及负债。

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	69,216,965.68	5.35
交易性金融资产-基金投资	—	—
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	69,216,965.68	5.35
假设	除股票价格发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变	
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)
	股票价格上涨5%	3,460,848.28
	股票价格下跌5%	-3,460,848.28

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差很小。

(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一层次的余额为人民币 72,922,728.74元，属于第二层次的余额为人民币1,507,944,434.34元，无属于

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	69,216,965.68	4.24
	其中：股票	69,216,965.68	4.24
2	固定收益投资	1,511,650,197.40	92.64
	其中：债券	1,511,650,197.40	92.64
	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	13,044,933.40	0.80
7	其他各项资产	37,780,636.53	2.32
8	合计	1,631,692,733.01	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

金额单位：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	32,267,952.09	2.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,266,000.00	0.10
E	建筑业	15,592.23	—
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	17,338,021.36	1.34
K	房地产业	3,107,000.00	0.24
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	15,222,400.00	1.18
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	69,216,965.68	5.35

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

金额单位：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	601318	中国平安	334,152	11,839,005.36	0.91
2	000333	美的集团	340,000	9,577,800.00	0.74

3	300070	碧水源	470,000	8,234,400.00	0.64
4	600066	宇通客车	400,000	7,836,000.00	0.61
5	000625	长安汽车	500,000	7,470,000.00	0.58
6	002573	清新环境	400,000	6,988,000.00	0.54
7	000651	格力电器	210,000	5,170,200.00	0.40
8	600340	华夏幸福	130,000	3,107,000.00	0.24
9	601336	新华保险	70,200	3,073,356.00	0.24
10	600305	恒顺醋业	149,300	1,743,824.00	0.13
11	600900	长江电力	100,000	1,266,000.00	0.10
12	601009	南京银行	108,000	1,170,720.00	0.09
13	002142	宁波银行	69,000	1,148,160.00	0.09
14	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
15	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
16	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
17	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
18	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	—
19	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	—
20	300582	英飞特	1,359	35,157.33	—
21	603239	浙江仙通	924	29,059.80	—
22	002835	同为股份	1,126	24,220.26	—
23	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	—
24	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	—
25	002840	华统股份	1,814	11,881.70	—
26	002838	道恩股份	681	10,405.68	—
27	300586	美联新材	1,006	9,355.80	—
28	300591	万里马	2,396	7,355.72	—

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：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	002241	歌尔股份	22,630,096.05	1.75
2	000333	美的集团	13,171,068.00	1.02
3	601318	中国平安	12,186,987.32	0.94
4	600066	宇通客车	11,680,243.00	0.90
5	600048	保利地产	9,591,300.00	0.74
6	300070	碧水源	8,716,767.71	0.67
7	002573	清新环境	8,309,118.00	0.64
8	600340	华夏幸福	8,302,648.48	0.64
9	000625	长安汽车	8,226,290.00	0.64
10	601633	长城汽车	8,214,250.00	0.63
11	002236	大华股份	7,112,000.00	0.55
12	002146	荣盛发展	5,543,387.00	0.43
13	000651	格力电器	4,888,050.00	0.38
14	600305	恒顺醋业	4,004,328.00	0.31
15	601336	新华保险	3,188,120.00	0.25
16	002658	雪迪龙	3,022,392.38	0.23
17	600900	长江电力	2,926,600.00	0.23
18	601009	南京银行	1,936,600.00	0.15
19	600674	川投能源	1,787,600.00	0.14
20	002142	宁波银行	891,400.00	0.07

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位：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	002241	歌尔股份	22,262,699.44	1.72
2	600048	保利地产	9,082,624.36	0.70
3	601633	长城汽车	8,808,222.00	0.68
4	002236	大华股份	6,737,562.00	0.52

5	000333	美的集团	6,233,800.00	0.48
6	002146	荣盛发展	5,808,843.90	0.45
7	600340	华夏幸福	4,497,025.00	0.35
8	600066	宇通客车	3,110,677.00	0.24
9	002658	雪迪龙	2,906,200.00	0.22
10	600305	恒顺醋业	2,873,612.00	0.22
11	600900	长江电力	1,964,019.00	0.15
12	600674	川投能源	1,912,600.00	0.15
13	002573	清新环境	1,242,743.00	0.10
14	601009	南京银行	1,121,400.00	0.09
15	600977	中国电影	1,072,462.92	0.08
16	601611	中国核建	852,727.59	0.07
17	000625	长安汽车	780,000.00	0.06
18	603858	步长制药	613,924.00	0.05
19	601997	贵阳银行	613,812.60	0.05
20	600909	华安证券	554,700.32	0.04

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	150,807,219.80
卖出股票的收入（成交）总额	96,201,387.19

注：买入股票的成本、卖出股票的收入总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	274,326,000.00	21.20
	其中：政策性金融债	274,326,000.00	21.20

4	企业债券	490,786,899.40	37.93
5	企业短期融资券	390,636,000.00	30.19
6	中期票据	129,946,000.00	10.04
7	可转债	176,465,298.00	13.64
8	同业存单	49,490,000.00	3.82
9	其他	—	—
10	合计	1,511,650,197.40	116.82

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	140205	14国开05	900,000	101,367,000.00	7.83
2	132005	15国资EB	793,970	88,130,670.00	6.81
3	041663003	16首钢CP001	700,000	70,154,000.00	5.42
4	160304	16进出04	600,000	59,910,000.00	4.63
5	132004	15国盛EB	540,000	53,438,400.00	4.13

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

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

根据本基金合同，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

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。

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	61,652.44
2	应收证券清算款	7,526,466.34
3	应收股利	—
4	应收利息	30,188,246.41
5	应收申购款	4,271.34
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	37,780,636.53

8.12.4 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	110032	三一转债	3,683,631.60	0.28
2	127003	海印转债	259,823.40	0.02

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
7,858	160,393.68	137,173,551.48	10.88%	1,123,199,970.57	89.12%

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	115,593.38	0.01%

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
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(2016年2月3日)基金份额总额	1,446,447,428.88
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,538,397.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	195,612,303.89
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,260,373,522.05

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事项。

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1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。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元 数量	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	242,530,633 .13	100.00%	177,363.08	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 资历雄厚，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在上述租用的券商交易单元中，海通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。

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	943,838, 955.26	100.00%	33,401,9 00,000.0 0	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	中国证券报、上海证券报、	2016-01-04

	年1月4日指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	证券时报、 www.cib-fund.com.cn	
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	兴业保本混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-13
4	兴业保本混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-13
5	兴业保本混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-13
6	兴业保本混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-13
7	兴业保本混合型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-01-13
8	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
9	兴业保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-02-04
10	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-03-22
11	兴业保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-04-01
12	兴业基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证券报、	2016-04-22

	基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	证券时报、 www.cib-fund.com.cn	
13	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-05-06
14	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-05-10
15	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
16	兴业基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在代销渠道认（申）购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-05-28
17	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
18	兴业基金管理有限公司关于参加代销机构开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-06-30
19	兴业保本混合型证券投资基金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
20	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、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-08-17
21	关于兴业基金管理有限公司旗下基金参与中国银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-08-18
22	兴业保本混合型证券投资基金2016年半年度报告	www.cib-fund.com.cn	2016-08-24
23	兴业保本混合型证券投资基金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

24	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、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-08-24
25	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-09-06
26	兴业保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016年第1号）	www.cib-fund.com.cn	2016-09-14
27	兴业保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2016年第1号）摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-09-14
28	关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-09-20
29	兴业基金管理有限公司关于旗下基金代销机构名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-09-24
30	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-10-11
31	兴业保本混合型证券投资基金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
32	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-11-08
33	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-11-22
34	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

35	兴业基金管理有限公司关于旗下部分基金新增郑州银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-11-29
36	关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-11-29
37	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
38	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-08
39	关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-22
40	兴业基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构以及参加代销机构费率优惠活动并开通定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-23
41	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	中国证券报、上海证券报、 证券时报、 www.cib-fund.com.cn	2016-12-28
42	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
43	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保本混合型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《兴业保本混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业保本混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

12.2 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，投资人在办公时间内可免费查阅。

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