

农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资  
基金  
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：农银汇理基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	农银金泰定开债券
基金主代码	003691
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 27 日
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	451, 535, 789. 18 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于债券品种，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>(一) 封闭期内投资策略包括：</p> <p>1、宏观配置策略 宏观经济的运行状况是直接影响债券市场的重要因素，基金管理人将通过跟踪分析各项宏观经济指标的变化，考察宏观经济的变动趋势以及货币政策等对债券市场的影响。在此基础上，基金管理人将对未来短期、中期和长期债券市场的运行状况进行合理分析，并建立对预期利率走势和证券价格走势的基本判断。对于债券市场的主要考察指标包括：远期利率水平、市场短期资金流向、央行公开市场操作力度、货币供应量变动等。</p> <p>2、期限配置策略 为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在每个运作周期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期与基金剩余运作周期进行适当的匹配。</p> <p>3、期限结构策略 收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。</p> <p>4、债券投资策略 (1) 合理预计利率水平；(2) 灵活调整组合久期；</p>

	<p>(3) 科学配置投资品种；(4) 谨慎选择个券。</p> <p>5、资产支持类证券投资策略</p> <p>(二) 开放期内投资策略包括：</p> <p>在开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守 本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中证全债指数收益率×100%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于中低风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金，低于股票型、混合型基金。

### 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		农银汇理基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翟爱东	张志永
	联系电话	021-61095588	021-62677777-212004
	电子邮箱	lijianfeng@abc-ca.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-61095599	95561
传真		021-61095556	021-62159217

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.abc-ca.com">http://www.abc-ca.com</a>
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区银城路9号50层。

### § 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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	8,032,837.76
本期利润	7,861,075.58
加权平均基金份额本期利润	0.0174
本期基金份额净值增长率	1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0179
期末基金资产净值	459,621,577.44
期末基金份额净值	1.0179

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

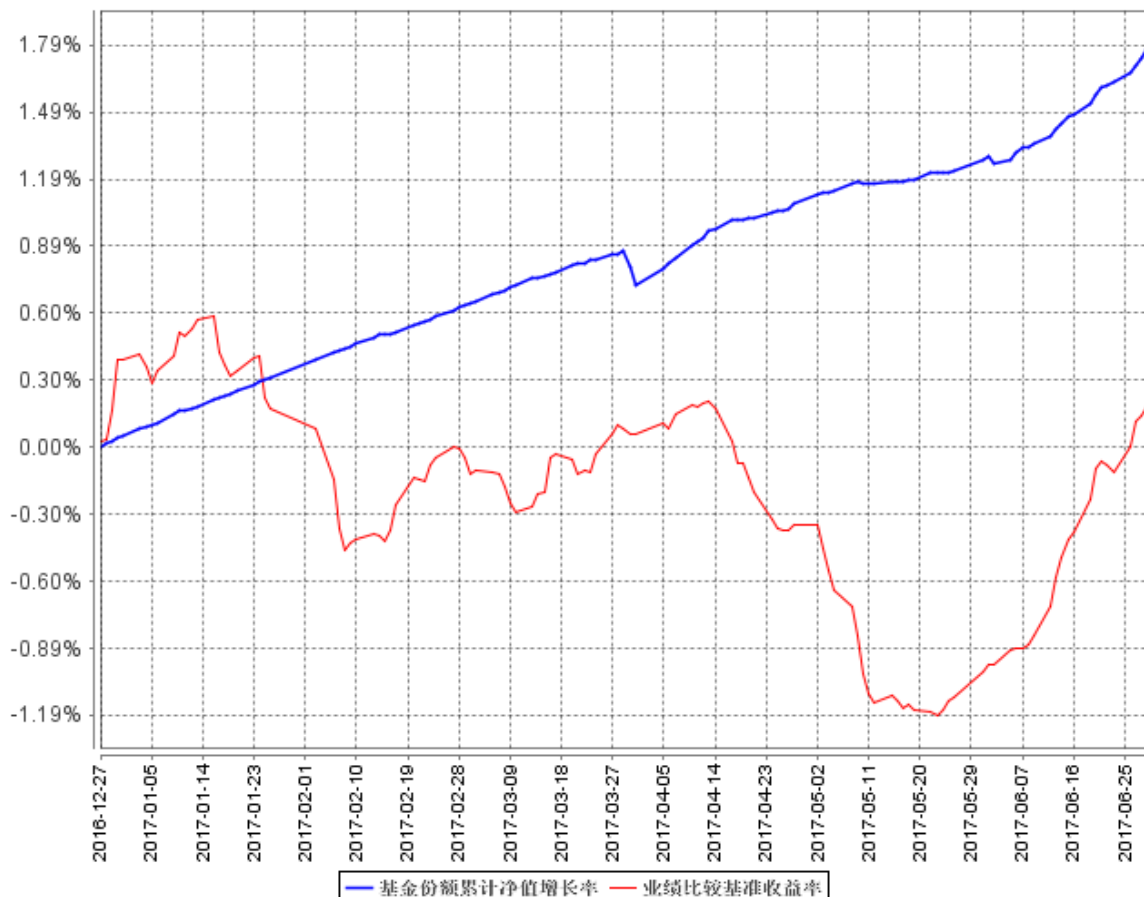
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.50%	0.02%	1.20%	0.05%	-0.70%	-0.03%
过去三个月	1.06%	0.02%	0.13%	0.07%	0.93%	-0.05%
过去六个月	1.74%	0.02%	-0.20%	0.07%	1.94%	-0.05%
自基金合同生效起至今	1.79%	0.02%	0.19%	0.08%	1.60%	-0.06%

### 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



基金的投资组合比例为：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，每个开放期开始前 1 个月至开放期结束后 1 个月内以及开放期不受前述比例限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整

## § 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

农银汇理基金管理有限公司成立于 2008 年 3 月 18 日，是中法合资的有限责任公司。公司注册资本为人民币贰亿零壹元，其中中国农业银行股份有限公司出资比例为 51.67%，东方汇理资产管理公司出资比例为 33.33%，中铝资本控股有限公司出资比例为 15%。公司办公地址为中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层。公司法定代表人为董事长于进先生。

截止 2017 年 6 月 30 日，公司共管理 39 只开放式基金，分别为农银汇理行业成长混合型证券投资基金、农银汇理恒久增利债券型证券投资基金、农银汇理平衡双利混合型证券投资基金、农银汇理策略价值混合型证券投资基金、农银汇理中小盘混合型证券投资基金、农银汇理大盘蓝筹混合型证券投资基金、农银汇理货币市场证券投资基金、农银汇理沪深 300 指数证券投资基金、农银汇理增强收益债券型证券投资基金、农银汇理策略精选混合型证券投资基金、农银汇理中证 500 指数证券投资基金、农银汇理消费主题混合型证券投资基金、农银汇理信用添利债券型证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、农银汇理行业轮动混合型证券投资基金、农银汇理 7 天理财债券型证券投资基金、农银汇理低估值高增长混合型证券投资基金、农银汇理行业领先混合型证券投资基金、农银汇理区间收益灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理研究精选灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理 14 天理财债券型证券投资基金、农银汇理红利日结货币市场基金、农银汇理医疗保健主题股票型证券投资基金、农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理信息传媒主题股票型证券投资基金、农银汇理工业 4.0 灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理天天利货币市场基金、农银汇理现代农业加灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理新能源主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理国企改革灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理金丰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金利一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理金穗纯债债券型证券投资基金、农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金、农银汇理日日鑫交易型货币市场基金、农银汇理金安 18 个月开放债券型证券投资基金、农银汇理尖端科技灵活配置混合型证券投资基金、农银汇理中国优势灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
史向明	本基金基金经理、公司投资副总监及固定收益部总经理	2016 年 12 月 27 日	-	17	理学硕士，具有基金从业资格。历任中国银河证券公司上海总部债券研究员、天治基金管理公司债券研究员及天治天得利货币市场基金经理、上投摩根基金管理公司固定收益部投资经理、农银汇理恒久增利债券型基金基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司投资副总监、固定收益部总经理及基金经理。

注：1、任职、离任日期是指公司作出决定之日，基金成立时担任基金经理和经理助理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业是指《证券业从业人员资格管理办法》规定的从业情况，也包括在其他金融机构从事证券投资研究等业务。

#### 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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产。报告期内，本基金未违反法律法规及基金合同的规定，也未出现对基金份额持有人利益造成不利影响的行为。

#### 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了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。



### 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。

未发生本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债券市场资金面中性偏紧，利率中枢抬升，各类债券收益率全线大幅上行，直至 6 月中下旬出现一定回落，但风险收益比相较年初有所改善，特别是短久期、高等级信用债配置价值凸显，而低评级债券的收益率和利差保护不足，个别民企风险有暴露。

本基金 2017 年上半年实施稳健和防控信用风险的投资风格，对经济形势、货币政策及市场流动性有较为充分的判断，认为大举加仓利率债的趋势性机会尚未显现。本基金在建仓初期选取了收益更有优势的定期存款和同业存单作为主要投资对象，在二季度择机增持高等级、中短久期信用债资产，取得了排名居前的投资收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0179 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.74%，业绩比较基准收益率为-0.20%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期内，经济动能仍较强，金融去杠杆尚未结束，债市整体处于震荡调整阶段，但我们对下半年债市并不悲观，一些债券的收益率已经具备票息配置价值，优选高评级、中短久期信用债，重点关注大型优质央企国企和龙头民企，对中低评级债券继续保持谨慎态度。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15 号）、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）与《关

于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件, 本公司制订了证券投资基金估值政策和程序, 并设立了估值委员会。

公司参与基金估值的机构及人员职责: 公司估值委员会负责本公司估值政策和程序的制定和解释, 并定期对估值政策和程序进行评价, 在发生影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况、以及当本公司旗下的证券投资基金在采用新投资策略或投资新品种时, 估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性, 必要时及时进行修订。公司运营部根据相关基金《基金合同》、《招募说明书》等文件关于估值的约定及公司估值政策和程序进行日常估值。基金经理根据市场环境的变化, 书面提示公司风险控制部和运营部测算投资品种潜在估值调整对基金资产净值的影响可能达到的程度。风险控制部提交测算结果给运营部, 运营部参考测算结果对估值调整进行试算, 并根据估值政策决定是否向估值委员会提议采用新的估值方法。公司监察稽核部对上述过程进行监督, 根据法规进行披露。

以上参与估值流程各方为公司各部门人员, 均具有基金从业资格, 具有丰富的基金从业经验和相关专业胜任能力, 且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理的代表作为公司估值委员会委员, 可以提议测算某一投资品种的估值调整影响, 并有权投票表决有关议案。基金经理有影响具体证券估值的利益需求, 但是公司的制度和组织结构约束和限制了其影响程度, 如估值委员会表决时, 其仅有一票表决权, 遵守少数服从多数的原则。

本公司未签约与估值相关的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据基金合同的要求, 报告期内本基金不需分配利润。

#### **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**

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定。报告期内, 本基金未出现上述情形。

## § 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

本托管人依据《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》与《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金托管协议》，自 2016 年 12 月 27 日起托管农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。

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

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

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

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

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

半年度财务会计报告（未经审计）

## § 6 资产负债表

会计主体：农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	40,378,439.87	451,494,597.86
结算备付金	2,077,295.43	-
存出保证金	12,942.25	-
交易性金融资产	422,476,737.00	-
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	422,476,737.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	11,000,000.00
应收证券清算款	12,000,000.00	-
应收利息	7,132,357.49	259,904.83
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	45,485.76
资产总计	484,077,772.04	462,799,988.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	12,000,000.00	-
应付证券清算款	12,007,114.25	11,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	263,592.10	34,550.77
应付托管费	37,656.01	4,935.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,807.55	-

应交税费	-	-
应付利息	-4,742.83	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	148,767.52	-
负债合计	24,456,194.60	11,039,486.59
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	451,535,789.18	451,535,789.18
未分配利润	8,085,788.26	224,712.68
所有者权益合计	459,621,577.44	451,760,501.86
负债和所有者权益总计	484,077,772.04	462,799,988.45

注：本基金的基金合同于 2016 年 12 月 27 日生效，报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0179 元，基金份额总额 451,535,789.18 份。

## 6.1 利润表

会计主体：农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	9,903,265.70	-
1.利息收入	10,039,132.99	-
其中：存款利息收入	7,892,971.18	-
债券利息收入	2,009,095.27	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	137,066.54	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	35,894.89	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	35,894.89	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-171,762.18	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-

减：二、费用	2,042,190.12	-
1. 管理人报酬	1,580,547.90	-
2. 托管费	225,792.57	-
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,182.34	-
5. 利息支出	70,864.79	-
其中：卖出回购金融资产支出	70,864.79	-
6. 其他费用	160,802.52	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	7,861,075.58	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	7,861,075.58	-

## 6.2 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	451,535,789.18	224,712.68	451,760,501.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,861,075.58	7,861,075.58
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	451,535,789.18	8,085,788.26	459,621,577.44

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-

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：

          许金超                                          刘志勇                                          徐华军            
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.3 报表附注

### 6.3.1 基金基本情况

农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 2406 号《关于核准农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由农银汇理基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集

451490303.42 元。经向中国证监会备案,《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 451535789.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 45485.76 份基金份额。本基金的基金管理人为农银汇理基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。自基金合同生效日(含该日)起或者自每一开放期结束之日次日(含该日)起一年的期间,为本基金的一个封闭期。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日(含该日)起一年。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日(含该日)起的一年,以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》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、企业债、公司债、可转换债券、次级债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、地方政府债、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不直接投资于股票、权证等权益类资产,也不参与新股申购或增发新股。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%,但应开放期流动性需要,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,现金或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%,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:中证全债指数收益率 $\times$ 100%

### 6.3.2 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—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《农银汇理金泰一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



### 6.3.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.3.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.3.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.3.4.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.3.4.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.3.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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[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》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

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

### 6.3.6 关联方关系

#### 6.3.6.1 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

报告期内对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.3.6.2 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
农银汇理基金管理有限公司	本基金的管理人
兴业银行股份有限公司	本基金的托管人

### 6.3.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.3.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.3.7.1.1 股票交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.3.7.1.2 债券交易**

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.3.7.1.3 债券回购交易**

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.3.7.1.4 权证交易**

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.3.7.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期无应支付关联方佣金。

**6.3.7.2 关联方报酬****6.3.7.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,580,547.90	-
其中：支付销售机构的客户维护费	868,631.87	-

注：支付基金管理人农银汇理基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

**6.3.7.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	225,792.57	-

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

**6.3.7.2.3 销售服务费**

本基金本报告期间无销售服务费。

**6.3.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.3.7.4 各关联方投资本基金的情况****6.3.7.4.1 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基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

**6.3.7.4.2 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**

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

**6.3.7.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	378,439.87	74,423.32	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

**6.3.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.3.7.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

**6.3.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.3.8.1 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。

**6.3.8.2 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因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.3.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.3.8.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

### 6.3.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止,本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 12,000,000 元,于 2017 年 7 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。

### 6.3.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

增值税:

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定:(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	422,476,737.00	87.27
	其中：债券	422,476,737.00	87.27
	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	42,455,735.30	8.77
7	其他各项资产	19,145,299.74	3.96
8	合计	484,077,772.04	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	182,343,096.40	39.67
5	企业短期融资券	220,279,000.00	47.93
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	84,640.60	0.02
8	同业存单	19,770,000.00	4.30
9	其他	-	-
10	合计	422,476,737.00	91.92

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041669030	16 王府井 CP002	300,000	30,030,000.00	6.53
2	112137	12 康得债	250,010	25,138,505.50	5.47
3	011698674	16 首钢 SCP004	200,000	20,070,000.00	4.37
4	011754038	17 金隅 SCP002	200,000	20,056,000.00	4.36

5	041656023	16 珠轨交 CP001	200,000	20,052,000.00	4.36
---	-----------	-----------------	---------	---------------	------

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一



年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.11.2

本基金投资的前十名股票没有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	12,942.25
2	应收证券清算款	12,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	7,132,357.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,145,299.74

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,040	56,161.17	9,835,945.52	2.18%	441,699,843.66	97.82%

### 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	0.00	0.0000%

### 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（2016年12月27日）基金份额总额	451,535,789.18
本报告期期初基金份额总额	451,535,789.18
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（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	451,535,789.18

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

报告期内基金管理人无重大人事变动。本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内未发生管理人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。本报告期内托管人的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

金额单位：人民币元

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

			例			
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准有：

- (1)、实力雄厚,注册资本不少于 20 亿元人民币。
- (2)、市场形象及财务状况良好。
- (3)、经营行为规范,内控制度健全,最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (4)、内部管理规范、严格,具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (5)、研究实力较强,具有专门的研究机构和专职研究人员,能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

公司研究部、投资部、投资理财部分别提出租用交易席位的申请,集中交易室汇总后提交总经理办公会议研究决定。席位租用协议到期后,研究部、投资部、投资理财部应对席位所属券商进行综合评价。总经理办公会议根据综合评价,做出是否续租的决定。

2、本基金本报告期新增中信证券交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	166,009,289.63	100.00%	723,800,000.00	100.00%	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

农银汇理基金管理有限公司（以下简称“本公司”）公司住所已于 2017 年 6 月 13 日变更为：中国（上海）自由贸易试验区银城路 9 号 50 层；上述变更已完成工商变更登记。

本公司已于 2017 年 6 月 16 日在中国证券报、上海证券报、证券时报以及公司网站上刊登上述公司住所变更的公告。

农银汇理基金管理有限公司

2017 年 8 月 28 日