

兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：兴银基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴银丰盈灵活配置
基金主代码	001474
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 24 日
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司
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	130,813,749.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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		兴银基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林佳	张志永
	联系电话	021-20296236	021-62677777-212004
	电子邮箱	lj@hffunds.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95561

传真	021-68630069	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	www.hffunds.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及托管人办公处

§ 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	1,112,919.13
本期利润	3,356,376.18
加权平均基金份额本期利润	0.0295
本期基金份额净值增长率	2.73%
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	0.1884
期末基金资产净值	157,343,368.30
期末基金份额净值	1.203

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。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），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

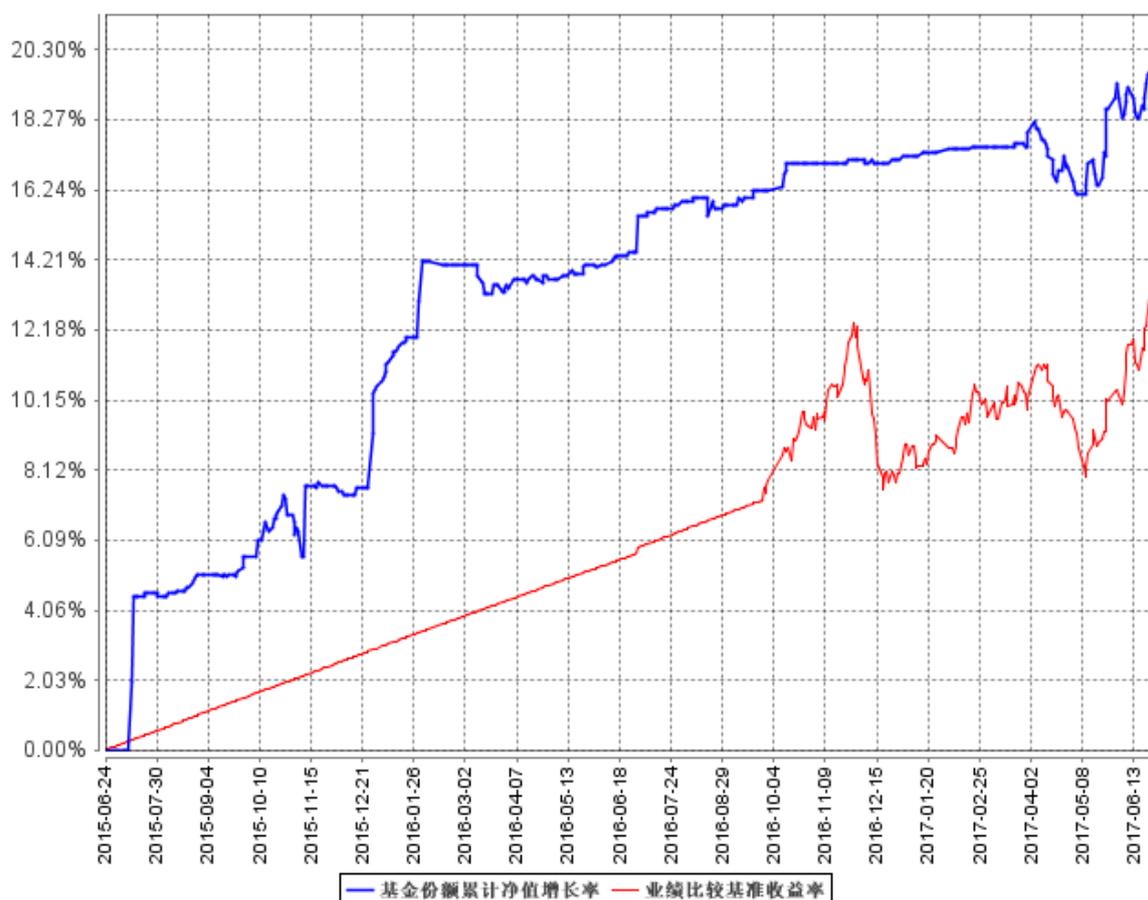
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.18%	0.25%	2.92%	0.33%	-1.74%	-0.08%
过去三个月	2.04%	0.27%	3.08%	0.31%	-1.04%	-0.04%
过去六个月	2.73%	0.20%	5.18%	0.28%	-2.45%	-0.08%
过去一年	4.25%	0.15%	7.28%	0.27%	-3.03%	-0.12%
自基金合同 生效起至今	20.30%	0.24%	13.59%	0.19%	6.71%	0.05%

注：1、本基金成立于 2015 年 6 月 24 日；

2、比较基准=五年银行定期存款利率（税后）+1%

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、本基金成立于 2015 年 6 月 24 日；

2、比较基准=五年银行定期存款利率（税后）+1%

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省平潭综合实验区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。公司经营范围包括基金募集、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。公司股东为华福证券有限责任公司与国脉科技股份有限公司。本公司经证监会证监许可（2013）1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券有限责任公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。

截至报告期末，本公司管理 17 只开放式基金，管理公募基金资产规模超 500 亿元。

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		
洪木妹	本基金的基金经理、公司总经理助理兼固定收益部总经理	2015 年 6 月 24 日	-	10 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），拥有 10 年证券、基金行业工作经验。曾任职于华福证券有限责任公司投资自营部和资产管理总部，从事宏观经济研究和投资工作，现任兴银基金管理有限责任公司总经理助理兼固定收益部总经理，自 2014 年 8 月起担任兴银货币市场基金基金经理、自 2015 年 6 月起担任兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、自 2015 年 11 月起担任兴银瑞益纯债债券型证券投资基金基金经理、自 2015 年 12 月起担任兴银稳健债券型证券投资基金基金经理、自 2016 年 10 月起担任兴银现金收益货币市场基金基金经理、自

					2016 年 12 月起担任兴银现金添利货币市场基金基金经理。
张晓南	基金经理	2015 年 11 月 19 日	-	7 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），拥有 7 年证券、基金行业工作经验。曾任职于鹏华基金管理有限公司，现任职于兴银基金管理有限公司权益投资部，自 2015 年 8 月起担任兴银大健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2015 年 11 月起担任兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 6 月起担任兴银消费新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告载明日期。

洪木妹女士为本基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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》等法律法规的规定及基金合同、招募说明书及其更新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，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

一季度，国内经济有所企稳，投资增速加快，制造业景气指数回升，央行突出强调货币政策稳健中性，上调公开市场操作利率，去杠杆态度坚决；国外美国预计全年加息 3-4 次，日欧宽松货币政策将逐步退出。受此影响，债券市场继续调整，一季度中债国开债 1 年期和 10 年期品种分别上行 38bps，曲线平坦化上行；中债中短期 AAA 级票据 1 年期和 5 年期分别上行 34bps 和 45bps，曲线陡峭化上行。10 年国开于 2 月初上行至 4.19%，而后在多空因素夹攻下震荡调整。进入 3 月，债券市场表现相对强劲，在消化了季末 MPA 考核等不利因素下，性价比相对较高的高等级信用债需求强劲，收益率出现明显下行。

二季度，一行三会严监管、去杠杆态度坚决且明确，市场在去杠杆预期下，流动性收缩明显。股市方面，投资者追逐流动性较好的蓝筹股，导致市场权重指数上涨；同时，全球各主要市场在流动性驱使下均大幅上涨，流动性外溢，伴随 A 股纳入 MSCI 利好落地，驱动 A 股北向资金流入。债券市场在 4、5 月份银行委外赎回较多、同业业务收缩、资金面较为紧张之际，债券收益率快速上行突破新高，10 年国债最高至 3.67%，5 年 AAA 级中票最高至 5.05%。进入 6 月，基于央行并未跟随美联储进行加息，财政部随买短期国债，同时投资者未雨绸缪谨慎对待季末效应、监管边际放松、上半年市场组合整体欠配等，多重因素使得市场需求整体向好，债券收益率先上后下，曲线有所修复。

由于当前整体证券市场风险偏好水平较低，本基金报告期内主要配置市场上业绩稳定同时增长预期明确的白马龙头股票，同时通过股票、债券的大类资产配置获取了较为稳健的投资收益。本基金将继续保持较为稳健的投资风格，并在市场风格发生切换时进行积极的转变，以获取较好的业绩。

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 1.2030 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.73%，业绩比较基准收益率为 5.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2017 年上半年宏观数据来看，整体经济保持平稳，二季度 GDP 同比增长与一季度持平，同时进出口数据进一步保持增长，房地产投资反弹，消费超预期回升，下半年预计仍较为乐观。金融工作会议后，金融监管可能会进一步加强，从“金融去杠杆”到“经济去杠杆”的背后，是对

金融监管核心的再次认知，更加强调金融市场服务实体经济的核心职能，同时“防止发生系统性金融风险”也预示证券市场后续有望得到较为稳定的发展空间。

本基金仍将投资具有稳定收益及增长预期的市场龙头公司，同时判断市场风格转变，在大类资产中进行配置，力争取得稳定的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 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

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管运营保障部的公司领导担任，成员由基金事务部、风险管理部、监察稽核部、研究发展部、投资管理部门(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。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

2. 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

3. 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4. 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

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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

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基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		2,144,121.50	1,252,274.13
结算备付金		543,154.73	2,527,272.78
存出保证金		26,718.67	2,218.93
交易性金融资产		107,042,988.39	7,060,800.00
其中：股票投资		68,127,988.39	-
基金投资		-	-
债券投资		38,915,000.00	7,060,800.00
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		47,492,149.99	40,000,000.00
应收证券清算款		-	13,354.85
应收利息		849,102.80	151,732.42
应收股利		-	-
应收申购款		129,651.74	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		158,227,887.82	51,007,653.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		450,539.44	-
应付赎回款		222,604.79	1,187.65
应付管理人报酬		103,151.79	34,406.18
应付托管费		12,893.99	4,300.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,787.45	1,400.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		93,542.06	179,301.49
负债合计		884,519.52	220,596.10
所有者权益：			

实收基金		130,813,749.62	43,358,206.61
未分配利润		26,529,618.68	7,428,850.40
所有者权益合计		157,343,368.30	50,787,057.01
负债和所有者权益总计		158,227,887.82	51,007,653.11

报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2030 元，基金份额总额 130813749.62 份。

6.2 利润表

会计主体：兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		4,143,585.59	4,779,256.02
1.利息收入		1,796,922.33	943,799.14
其中：存款利息收入		430,562.25	335,871.74
债券利息收入		980,522.55	415,306.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		385,837.53	192,620.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-339,878.23	4,485,493.38
其中：股票投资收益		-950,323.36	4,499,336.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-91,016.50	-13,843.33
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		701,461.63	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,243,457.05	-1,505,267.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		443,084.44	855,230.77
减：二、费用		787,209.41	466,816.57
1. 管理人报酬		524,392.05	299,752.16
2. 托管费		65,549.02	37,469.01
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		121,905.26	13,978.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		75,363.08	115,617.33
三、利润总额（亏损总额以“-”		3,356,376.18	4,312,439.45

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,356,376.18	4,312,439.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金

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）	43,358,206.61	7,428,850.40	50,787,057.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	3,356,376.18	3,356,376.18
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）	87,455,543.01	15,744,392.10	103,199,935.11
其中：1.基金申购款	179,558,564.26	31,456,497.99	211,015,062.25
2.基金赎回款	-92,103,021.25	-15,712,105.89	-107,815,127.14
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）	130,813,749.62	26,529,618.68	157,343,368.30
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
一、期初所有者权益（基金净值）	213,609,800.87	23,572,229.57	237,182,030.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	4,312,439.45	4,312,439.45

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）	-170,923,397.50	-21,294,804.29	-192,218,201.79
其中：1.基金申购款	36,732,966.80	5,486,458.99	42,219,425.79
2.基金赎回款	-207,656,364.30	-26,781,263.28	-234,437,627.58
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）	42,686,403.37	6,589,864.73	49,276,268.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署：

 张力

基金管理人负责人

 谢融

主管会计工作负责人

 沈阿娜

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金(以下简称本基金)经中国证监会证监许可(2015)1030号文准予注册,本次募集资金总额为人民币1,511,769,922.85元。本基金于2015年6月24日正式成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为华福基金管理有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《兴银丰盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关约定,本基金投资于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(包含中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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)。除被动持有权证外不主动投资权证。如法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可将其纳入投资范围。

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 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 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

本报告期内未发生会计估计的变更。

6.4.4.3 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。

6.4.5 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。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 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

本报告期末不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。

6.4.6.2 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
兴银基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
华福证券有限责任公司	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司	基金托管人

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：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

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
华福证券	4,076,484.60	100.00%	45,274,433.83	99.61%

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.7.1.4 权证交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比例

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华福证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华福证券	-	-	-	-

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30

	30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	524,392.05	299,752.16
其中：支付销售机构的客户维护费	169,139.77	17,753.70

注：本基金的管理费年费率为 0.8%。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	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	65,549.02	37,469.01

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-
获得销售服务费各关联方名称	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销售服务费
合计	-

本基金无销售服务费。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

本基金本报告期内及上年度可比期间与关联方未进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
	基金合同生效日（2015年6月24日）持有的基金份额	0.00
期初持有的基金份额	2,580,012.64	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	2,580,012.64	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.9700%	0.0000%

6.4.7.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基 金份额 占基金总 份额的比 例

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		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
兴业银行股份有限公司	2,144,121.50	169,447.07	36,742,366.63	335,871.74

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.8.1 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

6.4.10.1.1 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

			日							
--	--	--	---	--	--	--	--	--	--	--

6.4.10.1.2 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
------	------	-------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

6.4.10.1.3 受限证券类别：权证

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：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601088	中国神华	2017年6月5日	临时停牌	22.29	-	-	59,900	1,183,359.00	1,335,171.00	-

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

-

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
合计				-	-

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	68,127,988.39	43.06
	其中：股票	68,127,988.39	43.06
2	固定收益投资	38,915,000.00	24.59
	其中：债券	38,915,000.00	24.59
	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	47,492,149.99	30.02
	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	2,687,276.23	1.70
7	其他各项资产	1,005,473.21	0.64
8	合计	158,227,887.82	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,678,780.00	3.61
C	制造业	2,436,496.68	1.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	47,616.87	0.03
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,258,104.20	1.44
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	55,477,698.64	35.26

K	房地产业	2, 229, 292. 00	1. 42
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	68, 127, 988. 39	43. 30

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
合计	-	-

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	601398	工商银行	1, 525, 442	8, 008, 570. 50	5. 09
2	601288	农业银行	2, 235, 900	7, 870, 368. 00	5. 00
3	601939	建设银行	1, 272, 800	7, 827, 720. 00	4. 97

4	601988	中国银行	1,998,200	7,393,340.00	4.70
5	601211	国泰君安	113,586	2,329,648.86	1.48
6	600030	中信证券	132,500	2,255,150.00	1.43
7	600999	招商证券	130,600	2,248,932.00	1.43
8	601006	大秦铁路	267,000	2,240,130.00	1.42
9	600048	保利地产	223,600	2,229,292.00	1.42
10	601318	中国平安	44,700	2,217,567.00	1.41

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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	9,727,042.00	19.15
2	601288	农业银行	9,585,679.00	18.87
3	601398	工商银行	9,530,698.00	18.77
4	601988	中国银行	9,290,181.00	18.29
5	601998	中信银行	5,297,489.00	10.43
6	601328	交通银行	5,294,620.00	10.43
7	601169	北京银行	5,288,161.67	10.41
8	601009	南京银行	5,283,161.80	10.40
9	600036	招商银行	5,276,664.56	10.39
10	601229	上海银行	5,254,771.00	10.35
11	601818	光大银行	3,840,625.00	7.56
12	600015	华夏银行	3,827,576.82	7.54
13	600000	浦发银行	3,825,845.70	7.53
14	600958	东方证券	2,245,121.80	4.42
15	601857	中国石油	2,200,807.00	4.33
16	600837	海通证券	2,182,412.00	4.30
17	600030	中信证券	2,171,063.00	4.27
18	601788	光大证券	2,167,261.43	4.27
19	601006	大秦铁路	2,156,314.00	4.25
20	600999	招商证券	2,136,891.00	4.21
21	600048	保利地产	2,132,460.00	4.20
22	601211	国泰君安	2,128,793.68	4.19

23	600028	中国石化	2,112,623.00	4.16
24	600104	上汽集团	2,064,233.13	4.06
25	601318	中国平安	1,938,244.00	3.82
26	601901	方正证券	1,194,558.00	2.35
27	601377	兴业证券	1,194,042.00	2.35
28	600029	南方航空	1,192,326.01	2.35
29	601766	中国中车	1,191,505.00	2.35
30	600109	国金证券	1,190,621.43	2.34
31	601186	中国铁建	1,190,567.00	2.34
32	601688	华泰证券	1,187,390.00	2.34
33	601198	东兴证券	1,186,460.58	2.34
34	601628	中国人寿	1,186,086.00	2.34
35	601088	中国神华	1,183,359.00	2.33
36	600518	康美药业	1,182,002.38	2.33
37	600893	航发动力	1,181,011.00	2.33
38	601336	新华保险	1,174,038.00	2.31
39	600519	贵州茅台	1,081,653.00	2.13

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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	4,673,942.61	9.20
2	601229	上海银行	4,238,469.33	8.35
3	601169	北京银行	3,984,178.02	7.84
4	601998	中信银行	3,926,927.57	7.73
5	601009	南京银行	3,866,932.61	7.61
6	601328	交通银行	3,777,549.37	7.44
7	600000	浦发银行	3,204,392.45	6.31
8	600015	华夏银行	3,059,833.16	6.02
9	601818	光大银行	2,748,527.09	5.41
10	601288	农业银行	1,921,948.00	3.78
11	601988	中国银行	1,921,670.00	3.78
12	601939	建设银行	1,915,576.00	3.77
13	601398	工商银行	1,906,420.00	3.75
14	600029	南方航空	1,325,621.54	2.61

15	600518	康美药业	1,314,727.27	2.59
16	601336	新华保险	1,282,813.11	2.53
17	601901	方正证券	1,258,034.29	2.48
18	601628	中国人寿	1,246,271.71	2.45
19	601688	华泰证券	1,221,168.53	2.40
20	600519	贵州茅台	1,211,141.67	2.38
21	601766	中国中车	1,164,561.16	2.29
22	601198	东兴证券	1,156,169.04	2.28
23	601377	兴业证券	1,141,075.03	2.25
24	601186	中国铁建	1,071,645.60	2.11
25	600109	国金证券	1,039,998.00	2.05

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	127,151,641.90
卖出股票收入（成交）总额	60,176,548.10

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	10,013,000.00	6.36
	其中：政策性金融债	10,013,000.00	6.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	28,902,000.00	18.37
9	其他	-	-
10	合计	38,915,000.00	24.73

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	140220	14 国开 20	100,000	10,013,000.00	6.36
2	111792414	17 宁波银行 CD041	100,000	9,677,000.00	6.15
3	111792315	17 宁波银行 CD040	100,000	9,675,000.00	6.15
4	111795284	17 广州农村商业银行 CD067	100,000	9,550,000.00	6.07

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：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（%）
----	------	------	-------	------	--------------

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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

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股指期货交易情况说明

7.10.1 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参与股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。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。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资前十名股票中，不存在前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 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	26,718.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	849,102.80
5	应收申购款	129,651.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,005,473.21

7.12.4 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 (%)

注：本基金本报告期内未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例

1, 141	114, 648. 33	2, 580, 012. 64	98. 03%	128, 233, 736. 98	1. 97%
--------	--------------	-----------------	---------	-------------------	--------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	林美容	25, 531, 063. 83	19. 52%
2	魏亚珍	4, 254, 468. 09	3. 25%
3	华福基金管理有限责任公司	2, 580, 012. 64	1. 97%
4	于任远	2, 117, 074. 20	1. 62%
5	何宝林	1, 282, 100. 14	0. 98%
6	李依玉	1, 270, 244. 52	0. 97%
7	孙绪华	1, 000, 000. 00	0. 76%
8	肖云香	897, 639. 46	0. 69%
9	郑义辉	846, 829. 69	0. 65%
10	马敏勇	846, 829. 69	0. 65%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1, 023. 88	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月24日）基金份额总额	1, 511, 769, 922. 85
本报告期期初基金份额总额	43, 358, 206. 61

本报告期基金总申购份额	179, 558, 564. 26
减: 本报告期基金总赎回份额	92, 103, 021. 25
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	130, 813, 749. 62

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金基金管理人人事变动如下:

2017 年 2 月 14 日, 基金管理人发布了高级管理人员变更公告, 副总经理郑泽星、副总经理卢银英于 2017 年 2 月 13 日离任。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未改变。

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为基金审计的会计师事务所。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	2	186,971,996.99	100.00%	55,447.57	100.00%	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动资源，协助基金投资；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

选择程序：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证券公司的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的证券公司。

2、报告期内租用证券公司交易单元未发生变更。

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
平安证券	-	-	1,324,300,000.00	98.95%	-	-
华福证券	4,076,484.60	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	14,000,000.00	1.05%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170516	34,781,739.13	0.00	34,781,739.13	0.00	0.00
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

- (1) 赎回申请延缓支付的风险
上述高占比投资者大额赎回时易构成本基金巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付的风险。
- (2) 基金净值大幅波动的风险
上述高占比投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。
- (3) 基金规模过小导致的风险
上述高占比投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴银基金管理有限责任公司
2017 年 8 月 29 日