

中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年06月30日
基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年08月28日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018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。

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

本报告期内基金未发生诉讼。

本报告期内自2018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

基金名称	中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金
基金代码	004249
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2016年11月04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	7,951,251,651.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

2.3 基金管理人及基金托管人

2.4 信息披露方式

§ 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

3.1.1 期间数据和指标

项目	本报告期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年同期 2017年01月01日至2017年06月30日
本期加权平均收益	177,565,568.41	248,067,513.22
加权平均基金份额本期利润	0.0223	0.0312
本期基金份额净值增长率	3.21%	4.62%
3.1.2 期末基金份额净值	0.9930	1.0000
期末可供分配基金份额利润	7,975,472,157.83	15,807,244.44
期末基金资产净值	7,951,251,651.79	7,951,251,651.79
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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、所述基金份额净值增长率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)。

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

项目	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益	①-②	①-③
过去一个月	0.20%	0.20%	0.38%	0.04%	-0.18%
过去三个月	1.29%	0.92%	1.12%	0.09%	0.02%
过去六个月	3.12%	0.97%	3.10%	0.04%	0.02%
过去一年	4.14%	0.00%	4.08%	0.04%	0.00%
最近两年内任	5.81%	0.00%	2.60%	0.00%	3.21%
报告期	-	-	-	-	-

注:本基金的业绩比较基准为:中证兴业中高等级信用债指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%

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的比较

3.2.3 基金管理人及基金托管人

3.2.4 信息披露方式

§ 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12亿元人民币,注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金管理、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2018年6月30日,兴业基金管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、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳收益两年理财债券型证券投资基金、兴业稳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、兴业添溢货币市场基金、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、兴业丰瑞灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业自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、兴业安润货币市场基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放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(或基金经理助理)期限	证券从业年限	说明
林朝晖	基金经理	2016-11-04	8	中国籍,硕士学位,金融风险管理师(CFRM),具有证券从业资格、基金从业资格,2010年7月至2013年6月,在兴业基金管理有限公司任资产管理部产品运营岗,2013年6月至2014年5月,在兴业基金管理有限公司任资产管理部产品运营岗,2014年5月至2018年6月,在兴业基金管理有限公司任资产管理部产品运营岗。

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”为根据公司章程确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明

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的行为。

4.3 管理人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管理制度》,公平对待旗下所有基金,确保基金在投资交易过程中得到公平对待。

易制度指导意见,完善相应制度和流程,通过系统和人工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

1.宏观分析

2.市场回顾

3.运作分析

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12亿元人民币,注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金管理、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2018年6月30日,兴业基金管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、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳收益两年理财债券型证券投资基金、兴业稳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、兴业添溢货币市场基金、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、兴业丰瑞灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业自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、兴业安润货币市场基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放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(或基金经理助理)期限	证券从业年限	说明
林朝晖	基金经理	2016-11-04	8	中国籍,硕士学位,金融风险管理师(CFRM),具有证券从业资格、基金从业资格,2010年7月至2013年6月,在兴业基金管理有限公司任资产管理部产品运营岗,2013年6月至2014年5月,在兴业基金管理有限公司任资产管理部产品运营岗,2014年5月至2018年6月,在兴业基金管理有限公司任资产管理部产品运营岗。

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”为根据公司章程确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司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 管理人报告期内本基金运作遵守情况的说明

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的行为。

4.3 管理人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管理制度》,公平对待旗下所有基金,确保基金在投资交易过程中得到公平对待。

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本报告 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
一、收入	273,706,239.67	105,190,803.52		
1.利息收入	224,272,915.89	106,138,296.96		
其中:存款利息收入	225,634.67	1,051,680.61		
债券利息收入	220,751,132.25	154,271,510.19		
资产支持证券利息收入	-	1,165,307.64		
其他利息收入	3,296,148.97	9,649,646.50		
2.投资收益	-21,068,621.53	-20,755,992.13		
其中:股票投资收益	-	-		
基金投资收益	-21,068,621.53	-21,352,953.42		
资产支持证券投资收益	-	506,961.29		
公允价值变动收益	-	-		
其他收入	-	-		
二、费用	3,984,688.20	2,981,262.44		
1.销售费用	-	-		
2.管理费用	3,984,688.20	2,981,262.44		
3.托管费用	-	-		
4.其他费用	-	-		
三、利润总额(亏损总额)	270,000,000.00	102,190,000.00		
四、净利润(净亏损)	270,000,000.00	102,190,000.00		
五、所有者权益(基金净值)变动表				
项目	2018年01月01日	2018年06月30日	2017年01月01日	2017年06月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	7,951,250,596.06	221,641,767.75	7,975,892,362.82	-
二、本期增减变动金额	-	248,067,513.72	248,067,513.72	-
1.本期基金投资净收益(基金净值变动额)	1,056.72	11.10	1,067.82	-
2.本期公允价值变动损益(净收益/净损失)	1,821.91	13.65	1,835.37	-
3.本期基金份额申购/赎回	-765.19	-2.36	-767.25	-
4.本期基金份额持有人申购/赎回款净额(净申购/净赎回)	-	-246,468,786.56	-246,468,786.56	-
5.本期其他综合收益(损失)	-	-	-	-
6.本期所有者权益(基金净值)变动	7,951,251,651.78	24,220,596.02	7,975,472,157.80	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

6.4 管理人报告

6.4.1 基金基本情况

6.4.2 基金产品说明

6.4.3 基金管理人及基金托管人

6.4.4 信息披露方式

6.4.5 主要财务指标和基金净值表现

6.4.6 管理人报告

6.4.7 基金管理人及基金经理情况

6.4.8 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12亿元人民币,注册地福建省福州市。兴业基金的业务范围包括基金管理、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2018年6月30日,兴业基金管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、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳收益两年理财债券型证券投资基金、兴业稳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、兴业添溢货币市场基金、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、兴业丰瑞灵活配置混合型证券投资基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业自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、兴业安润货币市场基金、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、兴业18个月定期开放债券型证券投资基金、兴业瑞丰6个月定期开放债券型证券投资基金、兴业福鑫债券型证券投资基金、兴业量化精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业安弘3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业嘉润3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业龙腾双益平衡混合型证券投资基金、兴业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金。

6.4.9 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明

6.4.10 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管理制度》,公平对待旗下所有基金,确保基金在投资交易过程中得到公平对待。

6.4.11 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。

6.4.12 异常交易行为的专项说明

6.4.13 异常交易行为的专项说明

6.4.14 异常交易行为的专项说明

6.4.15 异常交易行为的专项说明

6.4.16 异常交易行为的专项说明

6.4.17 异常交易行为的专项说明

6.4.18 异常交易行为的专项说明

6.4.19 异常交易行为的专项说明

6.4.20 异常交易行为的专项说明

6.4.21 异常交易行为的专项说明

6.4.22 异常交易行为的专项说明

6.4.23 异常交易行为的专项说明

6.4.24 异常交易行为的专项说明

6.4.25 异常交易行为的专项说明

6.4.26 异常交易行为的专项说明

6.4.27 异常交易行为的专项说明

6.4.28 异常交易行为的专项说明

6.4.29 异常交易行为的专项说明

6.4.30 异常交易行为的专项说明

6.4.31 异常交易行为的专项说明

6.4.32 异常交易行为的专项说明

6.4.33 异常交易行为的专项说明

6.4.34 异常交易行为的专项说明

6.4.35 异常交易行为的专项说明

6.4.36 异常交易行为的专项说明

6.4.37 异常交易行为的专项说明

6.4.38 异常交易行为的专项说明

6.4.39 异常交易行为的专项说明

6.4.40 异常交易行为的专项说明

6.4.8.1.2 权证交易

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

6.4.8.2.2 基金托管费

6.4.8.2.3 基金销售服务费

6.4.8.2.4 基金业绩报酬

6.4.8.2.5 基金业绩报酬

6.4.8.2.6 基金业绩报酬

6.4.8.2.7 基金业绩报酬

6.4.8.2.8 基金业绩报酬

6.4.8.2.9 基金业绩报酬

6.4.8.2.10 基金业绩报酬

6.4.8.2.11 基金业绩报酬

6.4.8.2.12 基金业绩报酬

6.4.8.2.13 基金业绩报酬

6.4.8.2.14 基金业绩报酬

6.4.8.2.15 基金业绩报酬

6.4.8.2.16 基金业绩报酬

6.4.8.2.17 基金业绩报酬

6.4.8.2.18 基金业绩报酬

6.4.8.2.19 基金业绩报酬

6.4.8.2.20 基金业绩报酬

6.4.8.2.21 基金业绩报酬

6.4.8.2.22 基金业绩报酬

6.4.8.2.23 基金业绩报酬

6.4.8.2.24 基金业绩报酬

6.4.8.2.25 基金业绩报酬

6.4.8.2.26 基金业绩报酬

6.4.8.2.27 基金业绩报酬

6.4.8.2.28 基金业绩报酬

6.4.8.2.29 基金业绩报酬

6.4.8.2.30 基金业绩报酬

6.4.8.2.31 基金业绩报酬

6.4.8.2.32 基金业绩报酬

6.4.8.2.33 基金业绩报酬

6.4.8.2.34 基金业绩报酬

6.4.8.2.35 基金业绩报酬

6.4.8.2.36 基金业绩报酬