

兴业安和 6个月定期开放债券型发起式证券投资基金 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:交通银行股份有限公司

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...

2.1 基金基本情况 基金名称:兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金 基金代码:005442

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前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值。

2.3 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

2.4 信息披露方式 信息披露网站:www.cib-fund.com.cn 基金年度报告全文的披露网站:www.cib-fund.com.cn

3.1 主要会计数据和财务指标 金额单位:人民币元 3.1.1 主要会计数据和财务指标

3.1.2 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

3.2 基金业绩表现 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)扣除相关费用后的净额...

3.3 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.4 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.5 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.6 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.7 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.8 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.9 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.10 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.11 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.12 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.13 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.14 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.15 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.16 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.17 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.18 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.19 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.20 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.21 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.22 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.23 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

3.24 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.1.1 公平交易制度的执行情况 报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》...

4.1.2 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。

4.2 报告期内基金投资策略和运作分析 1、宏观经济分析 报告期内,世界经济整体延续复苏状态,但从先行指标上着欧元区域上增速显著放缓迹象...

2、市场回顾 债券市场方面,报告期内,债券资产价格有所分化,中债总全价指数上涨2.09%...

3、运作分析 上半年,随着去杠杆初见成效,稳杠杆成为当务之急,货币市场价格中概也逐步回归,带动整个收益率曲线同步下行...

4.2 报告期内基金业绩表现 截至报告期末,兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金净值为1.0038元...

4.3 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.4 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.5 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.6 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.7 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.8 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.9 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.10 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.11 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.12 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.13 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.14 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.15 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.16 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.17 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.18 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.19 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.20 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.21 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.22 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.23 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.24 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.25 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.26 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

4.27 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

注:1、报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0038元,基金份额总额2,009,999,000.00份。

2、本基金合同于2018年3月2日生效,本报告期不是完整报告期,本报告期按实际存续期间计算,无上年度可比期间数据。

6.2 利润分配 会计主体:兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金 报告期末:2018年03月02日(基金合同生效日)至2018年06月30日

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 本期 (This Period) 2018年03月02日至2018年06月30日

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:兴业安和6个月定期开放债券型发起式证券投资基金 报告期末:2018年03月02日(基金合同生效日)至2018年06月30日

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 本期 (This Period) 2018年03月02日至2018年06月30日

6.4 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.5 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.6 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.7 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.8 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.9 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.10 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.11 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.12 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.13 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.14 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.15 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.16 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.17 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.18 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.19 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.20 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.21 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.22 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.23 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.24 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.25 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.26 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.27 基金管理人及基金托管人 基金管理人:兴业基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

6.4.7.1 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变动列于上述公允价值变动列示。

6.4.7.2 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占公允价值净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。

6.4.7.3 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.4 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.5 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.6 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.7 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.8 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.9 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.10 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.11 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.12 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.13 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.19 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.21 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.22 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.23 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.24 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.25 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.26 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.27 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.28 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.29 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.30 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

6.4.7.31 公允价值变动收益 公允价值变动收益为估值日按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,并于相关金融资产卖出或到期时计入投资收益。

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%)

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组合 金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%)

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

Table with 5 columns: 序号 (Serial No.), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (Quantity), 公允价值 (Fair Value), 占基金资产净值比例 (%)

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 金额单位:人民币元

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

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

7.12 报告期末本基金投资的期权交易情况说明

7.13 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

7.14 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.15 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.16 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.17 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.18 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.19 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.20 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.21 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.22 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.23 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.24 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.25 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.26 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.27 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.28 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.29 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额

7.30 报告期末本基金持有的所有资产支持证券的公允价值、成本、期初及期末余额