# 兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

## §1 重要提示

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2019年8月23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2019年01月01日起至06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 | 兴全兴泰定开债券 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 004919 |
| 前端交易代码 | - |
| 后端交易代码 | - |
| 基金运作方式 | 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。 |
| 基金合同生效日 | 2017年8月31日 |
| 基金管理人 | 兴全基金管理有限公司 |
| 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 | 6,010,981,402.32份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | - |
| 上市日期 | - |

注:本基金不向个人投资者公开销售。

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下,追求基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 由于本基金存在开放期与封闭期,在开放期与封闭期将实行不同的投资策略。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,减小基金净值的波动。在封闭期内的投资将依托基金管理人自身信用评级体系和信用风险控制措施。采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,实现风险和收益的最佳配比。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于较低风险/收益的产品。 |

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 | | 兴全基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨卫东 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 021-20398888 | 021-52629999-2120056 |
| | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4006780099,021-38824536 | 95561 |
| 传真 | | 021-20398858 | 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 | http://www.xqfunds.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

## §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(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 212,074,463.39 |
| 本期利润 | 174,113,236.41 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0203 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.22% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0019 |
| 期末基金资产净值 | 6,052,860,288.32 |
| 期末基金份额净值 | 1.0070 |

注:1、上述财务指标采用的计算公式,详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第1号(主要财务指标的计算及披露)》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、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。

3、上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(例如:开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),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 | 0.49% | 0.02% | 0.57% | 0.03% | -0.08% | -0.01% |
| 过去三个月 | 1.03% | 0.04% | 0.63% | 0.06% | 0.40% | -0.02% |
| 过去六个月 | 2.22% | 0.04% | 2.07% | 0.06% | 0.15% | -0.02% |
| 过去一年 | 6.24% | 0.04% | 6.46% | 0.06% | -0.22% | -0.02% |
| 自成立以来 | 10.59% | 0.05% | 10.83% | 0.07% | -0.24% | -0.02% |

注:1、本基金业绩比较基准为:中证全债指数收益率,中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数有限公司编制并发布的首只债券类指数。样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,中证指数有限公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。该指数的一个重要特点在于对异常价格和无价情况下使用了模型价,能更为真实地反映债券的实际价值和收益率特征。

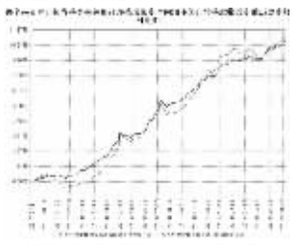
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =中证全债指数收益率 t / 中证全债指数收益率 t-1 -1

Benchmark t =(1+Return t)×(1+Benchmark t-1)-1

其中,t =1,2,3,…T,T表示时间截至日。

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



注:1、净值表现所取数据截至到2019年6月30日。

2、按照《兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为自2017年8月31日至2018年2月28日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## §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

兴全基金管理有限公司(成立时名为“兴业基金管理有限公司”,以下简称“公司”)经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月,中国证监会批复(证监许可[2008]6号),同意全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日,公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后,公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元,其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%,全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008年7月,经中国证监会批准(证监许可[2008]888号), 公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后,公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”,注册资本增加为1.5亿元人民币,其中两股东出资比例不变。2016年12月28日,因公司发展需要,公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。

截止2019年6月30日,公司旗下管理着26只基金,分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(LOF)、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

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 任职日期 | 离任日期 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 张睿 | 固定收益部副总监,本基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2017年9月5日 | - | 14年 | 经济学硕士,历任红顶金融工程研究中心研究部经理,申银万国证券研究所高级分析师,兴全基金管理有限公司研究员、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理。 |
| 季伟杰 | 本基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2019年6月28日 | - | 5年 | 金融学博士,历任天津银行股份有限公司任博士后研究,中信建投证券研究发展部宏观债券团队债券分析师,兴全基金管理有限公司固定收益部研究员、兴全货币市场证券投资基金基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理助理。 |
| 瞿秀华 | 固定收益部总监助理、本基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全祥泰定期开放债券型证券投资基金基金经理 | 2017年8月31日 | 2019年4月25日 | 9年 | 医学硕士,历任毕马威华振会计师事务所审计,泰信基金管理有限公司交易总监助理,兴全基金管理有限公司研究员兼基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金基金经理。 |

注:1、职务指截止报告期末的职务(报告期末仍在任的)或离任前的职务(报告期内离任的)。

2、任职日期指基金合同生效之日(基金成立时即担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理);离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或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 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在非公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度,未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所有投资组合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不存在超过该证券当日成交量的5%的情况, 未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

报告期内,债券资产总体表现依然良好,绝对收益率呈现低位震荡走势,同时短端资产受益于资金面宽松的确定性,中长端利率窄幅震荡,收益率曲线相对陡峭化。

年初在宽货币政策向宽信用传导缓慢, 经济下行压力加大的情况下,市场对经济一致预期悲观,但一季度开始社融投放力度加大,增速触底回升, 实体企业流动性环境显著好转, 同时中美谈判呈现 “积极进展”,叠加财政支出前置,经济出现托底企稳迹象,此阶段市场对于风险资产情绪明显变得乐观。而二季度经济企稳以及社融增速见底后的延续性受到挑战,首先随着宏观杠杆率的上升,货币政策强调定力趋于稳健,前期社融主要增加的也是短期流动性项目以及地方专项债;其次上半年对经济贡献较大的还是地产和财政前置推动的基建,随着地产政策再度收紧和专项债的发行释放,其持续性存在压力;另外中美贸易谈判的突然升级以及包商事件对流动性和打破刚兑的冲击也对市场预期带来影响。债券市场收益率在二季度呈现先上后下的波动表现,但波动空间总体较小,绝对收益率窄幅震荡,收益率曲线也表现出一定的陡峭化。

报告期内受益于银行间资金面的整体宽松和信用环境的修复,信用利差大幅下降,票息策略整体略好于久期策略。但同时信用分层也很明显,去杠杆的大环境下,信用违约事件依然频繁出现,优质龙头企业和低评级企业之间差异加大,尤其在包商事件之后,市场风险偏好普遍下降,低等级信用债评级利差迅速走阔。

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1.0070元;本报告期基金份额净值增长率为2.22%,业绩比较基准收益率为2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全年来看债券市场表现可能还是不错, 市场大的拐点暂未看到,目前市场仍面临几重利好:其一,国内经济仍处在底部区域,政策不太可能走大幅放水的老路,各项指标从企稳到上行缺乏大的空间,因此对债市仍然存在一定的支撑作用。其二,货币政策预计保持稳健偏宽松基调,同时 “双轨合一”有望加速推进,变相降息有望下半年落地。其三,国外央行开启降息周期且外资对国内债市的持续买入均对债市构成实实在在的利好。其四,三季度PPI转负,CPI下行,对债市也形成一定支撑。下半年收益率曲线的陡峭形态能否趋于平坦化值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程,选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议,并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后,由IT人员或IT人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级,以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略,并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误;4、投资人员(包括基金经理)积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素,并就可能带来的影响提出建议和意见;5、监察稽核人员参与估值方案的制定,确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定,定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查,确保估值委员会决议的有效执行,负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内进行了2次利润分配,共分配207,056,608.53元,符合本基金基金合同的相关规定。

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

无。

## §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。

## §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:兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日: 2019年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 4,357,427.51 | 55,322,483.31 |
| 结算备付金 | | 44,162,175.93 | 34,110,358.03 |
| 存出保证金 | | 131,481.60 | 106,926.11 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 8,846,955,600.00 | 13,137,651,600.60 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 8,846,955,600.00 | 13,137,651,600.60 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | 279,940,939.91 |
| 应收证券清算款 | | 141,669,684.33 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 158,825,469.96 | 207,704,578.76 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | 43,757.59 |
| 资产总计 | | 9,196,101,839.33 | 13,714,880,644.31 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 3,138,985,361.76 | 3,608,537,121.08 |
| 应付证券清算款 | | 93,767.39 | 601,178.00 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,497,411.56 | 2,626,988.24 |
| 应付托管费 | | 499,137.17 | 875,662.75 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 131,686.11 | 203,617.33 |
| 应交税费 | | 686,406.25 | 968,657.71 |
| 应付利息 | | 1,263,968.96 | 4,165,379.19 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 83,811.81 | 155,000.00 |
| 负债合计 | | 3,143,241,551.01 | 3,618,133,604.30 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 6,010,981,402.32 | 10,010,725,793.77 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 41,878,886.00 | 86,021,246.24 |
| 所有者权益合计 | | 6,052,860,288.32 | 10,096,747,040.01 |
| 负债和所有者权益总计 | | 9,196,101,839.33 | 13,714,880,644.31 |

注:1、报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0070元,基金份额总额6,010,981,402.32份。

6.2 利润表

会计主体:兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 231,475,929.75 | 443,397,513.41 |
| 1.利息收入 | | 224,602,762.03 | 272,846,102.36 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 628,487.67 | 625,307.55 |
| 债券利息收入 | | 221,890,191.51 | 272,220,794.81 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,084,082.85 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 44,834,394.70 | 28,295,111.50 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 44,834,394.70 | 28,295,111.50 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | -37,961,226.98 | 142,228,340.47 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.18 | - | 27,959.08 |
| 减:二、费用 | | 57,362,693.34 | 90,491,374.56 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 12,922,749.81 | 15,108,404.40 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,307,583.20 | 5,036,134.77 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 70,413.52 | 66,359.82 |
| 5. 利息支出 | | 39,475,039.95 | 69,590,661.24 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 39,475,039.95 | 69,590,661.24 |
| 6. 税金及附加 | | 462,063.36 | 574,999.68 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 124,843.50 | 114,814.65 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 174,113,236.41 | 352,906,138.85 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 174,113,236.41 | 352,906,138.85 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019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) | 10,010,725,793.77 | 86,021,246.24 | 10,096,747,040.01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 174,113,236.41 | 174,113,236.41 |
| 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) | -3,999,744,391.45 | -11,198,988.12 | -4,010,943,379.57 |
| 其中:1.基金申购款 | 255,608.55 | 1,011.88 | 256,620.43 |
| 2.基金赎回款 | -4,000,000,000.00 | -11,200,000.00 | -4,011,200,000.00 |
| 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) | - | -207,056,608.53 | -207,056,608.53 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 6,010,981,402.32 | 41,878,886.00 | 6,052,860,288.32 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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) | 10,010,039,787.50 | 13,928,768.43 | 10,023,968,555.93 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 352,906,138.85 | 352,906,138.85 |
| 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) | 199,425.15 | 2,374.10 | 201,799.25 |
| 其中:1.基金申购款 | 199,425.15 | 2,374.10 | 201,799.25 |
| 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) | - | -200,201,789.25 | -200,201,789.25 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 10,010,239,212.65 | 166,635,492.13 | 10,176,874,704.78 |

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:

_____兰 荣_____ _____庄 园 芳_____ _____詹鸿飞_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金 (以下简称 “本基金”)系由本基金管理人兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全兴泰定期开放债券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]1139号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集基金份额为10,009,999,850.00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(17)第00370号验资报告。基金合同于2017年8月31日正式生效, 基金份额持有人大会于2017年11月16日表决通过了《关于调整兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金管理费事项的议案》,根据本次大会通过的决议,管理人对《兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》、《兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》进行相应修订,并报中国证监会备案。本基金的管理人为兴全基金管理有限公司,托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具等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)。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%,但每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在开放期持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受上述限制;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率。

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于2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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]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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3)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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期内与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。

6.4.7.2 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 |
|---|---|
| 兴全基金管理有限公司(以下简称“兴全基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”) | 基金托管人 |
| 兴业证券股份有限公司(以下简称“兴业证券”) | 基金管理人的股东 |

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金不投资于股票。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 |
| 兴业证券 | 1,540,594,513.09 | 100.00% | 1,257,842,144.83 | 100.00% |

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 |
| 兴业证券 | 31,574,637,000.00 | 100.00% | 45,463,596,000.00 | 100.00% |

6.4.8.1.4 权证交易

本基金不投资于权证。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019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 |
| 兴业证券 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 |

本基金本报告期无应付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,922,749.81 | 15,108,404.40 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,307,583.20 | 5,036,134.77 |

注:1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 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 2019年1月1日至2019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 2018年1月1日至2018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 |
| 兴业银行 | - | 49,862,322.05 | - | - | 417,930,000.00 | 29,650.77 |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2017年8月31日)持有的基金份额 | 10,000,350.00 | 10,000,350.00 |
| 期初持有的基金份额 | 10,726,293.77 | 10,040,287.50 |
| 期间申购/买入总份额 | 255,608.55 | 199,425.15 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,981,902.32 | 10,239,712.65 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.1827% | 0.1023% |

注:1、期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定,符合公允性要求。

6.4.8.4.2 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 2019年6月30日 | | 上年度末 2018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 |
| 兴业银行 | 5,999,999,500.00 | 99.8173% | 9,999,999,500.00 | 99.8929% |

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018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 | 4,357,427.51 | 372,184.30 | 24,754,929.90 | 334,614.57 |

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末( 2019年6月30日 )本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金不投资于股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3