兴业14天理财债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴业14天理财	
基金主代码	003430	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月24日	
基金管理人	兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,121,526,641.53份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴业14天理财A	兴业14天理财B
下属分级基金的交易代码	003430	003431
报告期末下属分级基金的份额总额	5,790,516.84份	7,115,736,124.69份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性的基础上,力争实现超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略,在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,通过债券类属配置和收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资组合管理。
业绩比较基准	中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金及普通债券型证券投资基金,高于货币市场基金。

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		兴业基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王蕤	罗菲菲
	联系电话	021-22211888	010-58560666
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		40000-95561	95568
传真		021-22211997	010-58560798

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.cib-fund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及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01月01日-2019年06月30日)	
	兴业14天理财A	兴业14天理财B
本期已实现收益	77,058.37	113,310,297.17
本期利润	77,058.37	113,310,297.17
本期净值收益率	1.4151%	1.4349%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末基金资产净值	5,790,516.84	7,115,736,124.69
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

1、本基金收益分配按日结转份额。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业14天理财A

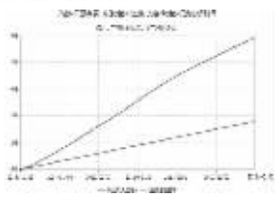
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2200%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.1090%	0.0017%
过去三个月	0.6704%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.3338%	0.0013%
过去六个月	1.4151%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	0.7456%	0.0012%
过去一年	3.0573%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	1.7073%	0.0012%
自基金合同生效起至今	9.8843%	0.0019%	3.6240%	0.0000%	6.2603%	0.0019%

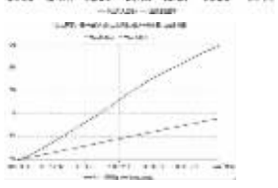
兴业14天理财B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2232%	0.0017%	0.1110%	0.0000%	0.1122%	0.0017%
过去三个月	0.6802%	0.0013%	0.3366%	0.0000%	0.3436%	0.0013%
过去六个月	1.4349%	0.0012%	0.6695%	0.0000%	0.7654%	0.0012%
过去一年	3.0982%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	1.7482%	0.0012%
自基金合同生效起至今	9.9626%	0.0019%	3.6240%	0.0000%	6.3386%	0.0019%

注:本基金的业绩比较基准为:七天通知存款基准利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





§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。截至2019年6月30日,兴业基金管理了兴业定期开放债券型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业收益增强债券型证券投资基金、兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金、兴业稳固收益两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、兴业丰利债券型证券投资基金、兴业丰泰债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、兴业天融债券型证券投资基金、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、兴业启元一年定期开放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14天理财债券型证券投资基金、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、兴业裕丰债券型证券投资基金、兴业嘉瑞6个月定期开放债券型证券投资基金(原兴业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、兴业增益三年定期开放债券型证券投资基金、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、兴业安弘3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、兴业机遇债券型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业添天盈货币市场基金、兴业鑫天盈货币市场基金、兴业稳天盈货币市场基金、兴业安润货币市场基金、兴业多策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、兴业突祥混合型证券投资基金(原兴业保本混合型证券投资基金)、兴业国企改革灵活配置混合型证券投资基金、兴业成长动力灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚惠灵活配置混合型证券投资基金、兴业短债债券型证券投资基金(原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、兴业聚盈灵活配置混合型证券投资基金、兴业聚鑫灵活配置混合型证券投资基金、兴业中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金(原兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金)、兴业聚丰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、兴业量化精选灵活配置混合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、兴业安保优选混合型证券投资基金、兴业中证国有企业改革指数增强型证券投资基金、兴业上证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、兴业养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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		
伍方方	基金经理	2018-05-28	-	9年	中国籍,硕士学位,具有证券投资基金从业资格。2010年12月至2017年12月,在兴业银行资金营运中心担任交易员,从事人民币资金交易、流动性管理、债券借贷、同业存单发行与投资交易、投资策略研究以及其他资产负债管理相关工作。2017年12月加入兴业基金管理有限公司,现任基金经理。

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"为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定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

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》,完善相应制度和流程,通过系统和人工等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,银行间资金面基本维持宽松,个别关键时点略有收紧,短期信用债和同业存单利率走出震荡行情,组合维持一定的杠杆水平,严控信用风险和流动性风险,做好资产负债管理,并合理布局资产期限,获取骑乘收益和套息收益。下一阶段,货币政策方面仍将保持稳健,保持流动性合理充裕,短端利率整体上可能会低位运行,将继续管理好流动性风险、信用风险和再投资风险,增强组合操作灵活性,做好流动性、安全性和收益性的平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业14天理财A基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为1.4151%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%;截至报告期末兴业14天理财B基金份额净值为1.000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为1.4349%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,整体判断市场整体流动性预计依然会维持"合理充裕"的状态,但随着国内外形势及经济情况的变化,政策将更加注重预调微调,政策的侧重点或重新回归到金融供给侧改革、疏通货币政策传导路径上来,资金面或将较上半年面对更大的波动幅度,边际上或有一定的收敛。组合操作方面,组合将继续坚持流动性、安全性及收益性的合理权衡,加强对宏观利率走势的研判,做好组合的流动性管理,监控各项指标,确保安全合规运作,在确保流动性和安全性的前提下,兼顾好收益性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、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

(1)公司方面

估值委员会设主任委员一名,由分管运营的公司领导担任;委员若干名,由基金运营部、风险管理总部、研究部、投资管理总部(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。

估值委员会主要工作职责如下:制定合理、公允的估值方法;对估值方法进行讨论并作出评价,在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用;评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性,对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定;讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

(2)托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

5、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

本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,按日进行支付。报告期内本基金向A级份额持有人分配利润77,058.37元,向B级份额持有人分配利润113,310,297.17元。

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,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:兴业14天理财债券型证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	9,230,993.76	5,426,219.16
结算备付金	696,814.75	45,454.55
存出保证金	25,258.73	-
交易性金融资产	6,742,369,359.50	7,437,875,525.64
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	6,712,181,010.25	7,437,875,525.64
资产支持证券投资	30,188,349.25	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	934,840,002.26	1,010,659,185.98
应收证券清算款	-	-
应收利息	21,030,281.96	34,755,642.23
应收股利	-	-
应收申购款	26,642.64	2,100.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,708,219,353.60	8,488,764,127.56
负债和所有者权益	本期末 2019年06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	-	-
卖出回购金融资产款	584,299,507.85	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,501,101.26	2,125,392.62
应付托管费	480,352.41	680,125.62
应付销售服务费	60,246.85	85,193.22
应付交易费用	107,454.67	99,447.20
应交税费	58,783.23	-
应付利息	70,127.90	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	115,137.90	369,000.00
负债合计	586,692,712.07	3,359,158.66
所有者权益:		
实收基金	7,121,526,641.53	8,485,404,968.90
未分配利润	-	-
所有者权益合计	7,121,526,641.53	8,485,404,968.90
负债和所有者权益总计	7,708,219,353.60	8,488,764,127.56

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.00元,基金份额总额7,121,526,641.53份,其中A类基金份额5,790,516.84份,B类基金份额7,115,736,124.69份。

6.2 利润表

会计主体:兴业14天理财债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	130,983,003.83	228,413,737.12
1.利息收入	125,317,862.91	227,551,337.25
其中:存款利息收入	122,845.17	7,916,863.75
债券利息收入	106,627,846.00	218,955,461.94
资产支持证券利息收入	6,908.99	-
买入返售金融资产收入	18,560,262.75	679,011.56
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,665,123.37	862,399.87
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,665,123.37	862,399.87
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)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	17.55	-
减:二、费用	17,595,648.29	17,832,859.11
1. 管理人报酬	9,865,111.49	12,563,867.83
2. 托管费	3,156,835.68	4,020,437.66
3. 销售服务费	395,697.70	505,981.12
4. 交易费用	275.00	-
5. 利息支出	4,009,684.42	497,088.16
其中:卖出回购金融资产支出	4,009,684.42	497,088.16
6. 税金及附加	17,962.42	-
7. 其他费用	150,081.58	245,484.34
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	113,387,355.54	210,580,878.01
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	113,387,355.54	210,580,878.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴业14天理财债券型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	8,485,404,968.90	-	8,485,404,968.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	113,387,355.54	113,387,355.54
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)	-1,363,878,327.37	-	-1,363,878,327.37
其中:1.基金申购款	8,747,041,210.70	-	8,747,041,210.70
2.基金赎回款	-10,110,919,538.07	-	-10,110,919,538.07
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)	-	-113,387,355.54	-113,387,355.54
五、期末所有者权益(基金净值)	7,121,526,641.53	-	7,121,526,641.53
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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)	10,058,435,225.48	-	10,058,435,225.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	210,580,878.01	210,580,878.01
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)	170,126,699.80	-	170,126,699.80
其中:1.基金申购款	267,859,456.44	-	267,859,456.44
2.基金赎回款	-97,732,756.64	-	-97,732,756.64
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)	-	-210,580,878.01	-210,580,878.01
五、期末所有者权益(基金净值)	10,228,561,925.28	-	10,228,561,925.28

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:

官恒秋	庄孝强	楼怡斐
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

兴业14天理财债券型证券投资基金(以下简称"本基金")系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业14天理财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[2016]1945号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为200,015,054.71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(16)第0893号的验资报告。基金合同于2016年10月24日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称"兴业14天理财A")和B类基金份额(以下简称"兴业14天理财B")两类份额。其中,兴业14天理财A是指按照0.05%年费率计提销售服务费的基金份额类别;兴业14天理财B是指按照0.01%年费率计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为法律法规允许的金融工具包括:现金;期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公告的金融机构人民币七天通知存款基准利率(税后)。

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2019年06月30的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的的经营成果和基金净值变动情况。

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相一致。

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 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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股票、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

本报告期间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
兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司(以下简称"民生银行")	基金托管人
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司
中海集团投资有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联方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。

6.4.8.1.2 权证交易

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。

6.4.8.1.3 债券交易

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交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无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

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,865,111.49	12,563,867.83
其中:支付销售机构的客户维护费	3,169.16	8,569.92

注:支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.25%÷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01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,156,835.68	4,020,437.66

注:支付基金托管人民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.08%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业14天理财A	兴业14天理财B	合计
兴业基金	13.53	394,097.64	394,111.17
合计	13.53	394,097.64	394,111.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴业14天理财A	兴业14天理财B	合计
兴业基金	5.10	501,257.20	501,262.30
合计	5.10	501,257.20	501,262.30

注:本基金实行销售服务费分级收费方式,分设A、B两类基金份额:A类基金的销售服务费按前一日该类基金资产净值的0.05%的年费率计提,B类基金的销售服务费按前一日该类基金资产净值的0.01%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:

A类基金日销售服务费=前一日A类基金份额对应的资产净值×0.05%÷当年天数;

B类基金日销售服务费=前一日B类基金份额对应的资产净值×0.01%÷当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易的情况。

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

本基金本报告期内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。

6.4.8.4.2 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

兴业14天理财B

关联方名称	本期末 2019年06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	1,140,957,574.72	16.03%	0.00	0.0000%
民生银行	0.00	0.0000%	8,471,062,820.40	99.89%

注:1、本基金本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资兴业14天理财A的情况。

2、关联方投资本基金采用公允费率,即按照基金法律文件条款执行。

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01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	9,230,993.76	66,942.45	3,057,678.00	102,974.83

注:1、本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管,按银行同业或协议利率计算。

2、本基金本报告期存放于关联方的协议存款按银行约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2019年06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/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币584,299,507.85元,是以如下债券作为抵押:

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
111808253	18中信银行CD253	2019-07-01	99.15	2,000,000	198,300,813.43
111817155	18光大银行CD155	2019-07-01	99.87	2,500,000	249,679,124.34
111906014	19交通银行CD014	2019-07-01	98.33	1,900,000	186,826,339.78
合计				6,400,000	634,806,277.55

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	固定收益投资	6,742,369,359.50	87.47
	其中:债券	6,712,181,010.25	87.08
	资产支持证券	30,188,349.25	0.39
2	买入返售金融资产	934,840,002.26	12.13
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	9,927,808.51	0.13
4	其他各项资产	21,082,183.33	0.27
5	合计	7,708,219,353.60	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.71	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	584,299,507.85	8.20
	其中:买断式回购融资	-	-

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	117
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过134天。

在本报告期内本基金投自组合平均剩余期限未超过134天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	32.61	8.20
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	15.40	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(