兴业定期开放债券型证券投资基金

【2015】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:交通银行股份有限公司
送出日期:2015年8月26日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月20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。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业定期开放债券型证券投资基金
基金简称	兴业定开债券
基金主代码	000546
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月13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
报告期末基金份额总额	1,910,670,454.45份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过对影响市场各类要素的分析以及投资组合的积极主动管理,力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等,为实现最风险并实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

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		兴业基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱玮	孙震彦
	联系电话	021-22211888	95559
	电子邮箱	zhuwei@cib-fund.com.cn	tongyy@bankcomm.com
客户服务电话		400000-95561	95559
传真		021-22211997	021-62701216
注册地址		福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		章硕梁	张国钧

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区浦明路198号财富金融广场7号楼

§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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	158,207,539.75
本期利润	136,228,583.38
加权平均基金份额本期利润	0.0565
本期加权平均净值利润率	5.18%
本期基金份额净值增长率	5.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	102,530,416.30
期末可供分配基金份额利润	0.0537
期末基金资产净值	2,084,023,509.07
期末基金份额净值	1.091
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.39%

注:1、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。

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、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)。

4、本基金于2014年3月13日成立。

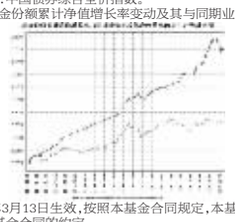
3.2 基金净值表现

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①1	份额净值增长率标准差②1	业绩比较基准收益率③1	业绩比较基准收益率标准差④1	①-③1	②-④1
过去一个月	-0.91%	0.27%	-0.08%	0.05%	-0.83%	0.22%
过去三个月	3.22%	0.23%	1.38%	0.10%	1.87%	0.13%
过去六个月	5.61%	0.18%	1.29%	0.10%	4.41%	0.08%
过去一年	11.48%	0.14%	3.66%	0.11%	7.88%	0.03%
自基金合同生效起至今	16.39%	0.13%	5.94%	0.11%	10.48%	0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数。

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:本基基金合同于2014年3月13日生效,按照本基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起六个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.3 其他指标

注:无。

§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海集团投资有限公司共同出资设立,公司注册资本5亿元人民币,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2015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、兴业聚利灵活配置混合型证券投资基金、兴业年年利定期开放债券型证券投资基金、兴业聚优灵活配置混合型证券投资基金、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投资基金、兴业添利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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
周晗	本基金的基金经理,固定收益投资总监	2014年3月13日	-	14	中国籍,工商管理硕士,具有证券投资基金从业资格。先后任职于天相投资顾问有限公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司从事基金投资、企业年金投资等。2009年加入申万菱信基金管理有限公司担任固定收益部总经理。2009年6月至2013年7月担任申万菱信收益宝货币基金基金经理。2009年6月至2013年7月担任申万菱信添益宝债券基金基金经理。2013年1月至2013年7月担任申万菱信鑫安债券基金基金经理。2011年12月至2013年7月担任申万菱信可转债债券基金基金经理。2013年8月加入兴业基金管理有限公司固定收益投资总监,基金经理。2014年3月13日起担任兴业定开债券基金基金经理。2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理。2015年5月21日起担任兴业聚优灵活配置混合基金基金经理。2015年5月29日起担任兴业收益增强债券基金基金经理。
徐莹	本基金的基金经理	2014年3月13日	-	7	中国籍,硕士学历,CFA,具有证券投资基金从业资格。2008年至2012年在兴业银行股份有限公司总行资金营运中心从事债券投资。2012年至2013年在兴业银行股份有限公司总行资产管理部负责组合投资管理。2013年6月加入兴业基金管理有限公司。2014年3月13日起担任兴业定开债券基金基金经理。2015年2月12日起担任兴业年年利定开债券基金基金经理。2015年6月10日起担任兴业稳固收益一年理财债券型证券投资基金基金经理。2015年6月10日起兴业稳固收益两年理财债券投资基金基金经理。

注:1、上述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。

3、2015年7月24日起徐莹不再担任兴业定期开放债券型证券投资基金基金经理、2015年7月24日起腊博担任兴业定期开放债券型证券投资基金基金经理,具体信息请参见2015年7月25日披露的《兴业定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告》。

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

2015年第一季度受制造业生产和投资增速回落拖累,叠加房地产和基建投资偏弱,消费增长乏力等因素的综合影响,经济开局不利,GDP下滑至7%;二季度托底政策持续出台的累积效应边际显现,房地产销量持续回升,经济有所企稳,但由于通胀偏低,货币政策仍然保持较为宽松的格局。外围发达经济体复苏分化,全球除美国外的主要经济货币政策竞相宽松,由于低通胀的因素,美国加息延迟。债券市场收益率整体处于区间震荡格局,信用利差收窄,符合当前经济环境特征。

报告期内,基于对债券绝对收益率水平、信用利差状况、资金面以及债券供需等多方面综合考虑,同时结合本基金一年定期开放的特征,维持组合中等久期、适度杠杆的策略,准确把握了表现较佳的债券品种的投资机会,适时通过可转债波段操作增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为5.61%,同期业绩比较基准收益率为1.2%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,随着经济潜在增速的下降,债券市场收益率长期下行的趋势并没有变,但下半年短期风险因素可能会有所增加,可能超出预期的风险来自于房价和农产品价格的持续回升,以及国内投资需求的改善和美元加息预期兑现,这些因素都会在一定程度上影响货币政策的实施空间。目前信用利差对预期风险的补偿并不太高,债券市场在乐观的条件下仍然会保持上半年的震荡格局,但不能排除发生中性和悲观的情景。我们将密切跟踪经济、政策、环境的变化,及时调整组合的久期和信用结构,继续秉承在风险可控的原则下为投资者提供更好的收益回报。

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

估值委员会由公司分管估值业务的领导、基金运营部负责人、研究部负责人、风险管理总部负责人、监察稽核部负责人、投资管理总部负责人组成。均具有丰富的证券研究、会计核算、风控、合规等证券基金行业从业经验及专业能力。除了投资总监外,其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的决策。

估值委员会主要工作职责如下:制定合理、公允的估值方法;不定期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的情况后应及时修订估值方法,以保证其持续适用;评价现有估值方法对新投资策略或投资新品种的适用性,对新投资策略或投资新品种采用的估值方法作出决定。

(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

根据《基金合同》,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的20%。

本基金本报告期内已实施利润分配1次,共分配利润226,596,463.27元,符合本基金合同规定。

本报告期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

报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§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

2015年上半年度,基金托管人在兴业定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年上半年度,兴业基金管理有限公司在兴业定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配,分配金额为226,596,463.27元。

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

2015年上半年度,由兴业基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴业定期开放债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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:兴业定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	27,391,137.47	1,417,881,354.83
结算备付金		10,638,004.87	18,367,870.41
存出保证金		91,310.58	5,910.00
交易性金融资产	6.4.7.2	3,177,836,817.32	4,340,618,979.93
其中:股票投资		29,820,000.00	-
基金投资		-	-
债券投资		3,038,706,309.10	4,161,918,902.12
资产支持证券投资		109,310,508.22	178,700,077.81
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	-	-
应收证券清算款		21,952,298.79	8,517,036.17
应收利息	6.4.7.5	73,795,444.38	219,416,987.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,311,705,013.41	6,004,808,138.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		1,225,098,790.00	2,422,725,907.25
应付证券清算款		-	10,031,052.61
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,208,215.57	2,111,157.64
应付托管费		345,204.47	603,187.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	19,109.29	45,002.84
应交税费		-	-
应付利息		902,007.87	1,741,732.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,177.14	180,000.00
负债合计		1,227,681,504.34	2,437,438,040.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,910,670,454.45	3,237,092,005.54
未分配利润	6.4.7.10	173,353,054.62	330,278,092.55
所有者权益合计		2,084,023,509.07	3,567,370,098.09
负债和所有者权益总计		3,311,705,013.41	6,004,808,138.65

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.091元,基金份额总额1,910,670,454.45份。

6.2 利润表

会计主体:兴业定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年3月13日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一、收入		182,333,034.62	167,934,329.04
1.利息收入		144,698,532.22	85,311,205.65
其中:存款利息收入	6.4.7.11	17,988,609.35	28,665,515.56
债券利息收入		122,919,810.71	53,497,866.28
资产支持证券利息收入		2,852,182.45	2,401,133.17
买入返售金融资产收入		247,929.71	746,690.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		60,311,601.09	1,027,219.55
其中:股票投资收益	6.4.7.12	240,120.58	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	58,250,974.76	1,525,341.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	1,820,505.75	-498,121.65
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	-22,058,956.17	81,594,103.84
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	73,857.48	1,800.00
减:二、费用		46,306,451.04	26,289,306.78
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	9,248,344.69	6,917,275.57
2.托管费	6.4.10.2.2	2,642,384.21	1,976,364.43
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	6.4.7.19	36,353.34	14,812.65
5.利息支出		34,042,701.66	17,307,840.09
其中:卖出回购金融资产支出		34,042,701.66	17,307,840.09
6.其他费用	6.4.7.20	136,667.14	73,014.04
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		136,228,583.58	141,645,022.26
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		136,228,583.58	141,645,022.26

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴业定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	3,237,092,005.54	330,278,092.55	3,567,370,098.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	136,228,583.58	136,228,583.58
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)	-1,326,421,551.09	-66,557,158.24	-1,392,978,709.33
其中:1.基金申购款	939,842,934.35	53,372,339.72	993,215,274.07
2.基金赎回款	-2,266,264,485.44	-119,929,497.96	-2,386,193,983.40
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)	-	-226,596,463.27	-226,596,463.27
五、期末所有者权益(基金净值)	1,910,670,454.45	173,353,054.62	2,084,023,509.07

项目	上年度可比期间 2014年3月13日(基金合同生效日)至2014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)	3,237,092,005.54	-	3,237,092,005.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	141,645,022.26	141,645,022.26
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,237,092,005.54	141,645,022.26	3,378,737,027.80

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:

_____卓新章_____ _____黄文锋_____ _____莫艳鸿_____

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

兴业定期开放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[2014]180号文批准公开募集。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3,237,092,005.54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(14)第0214号验资报告。基金合同于2014年3月13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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、集合债券、中小企业私募债券、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)、货币市场工具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相关规定。因持有可转换债券转股所得的股票、因所持股票派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证,应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产,也不参与一级市场新股的申购或增发。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。本基金的投资组合为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内不受前述比例限制。开放期内,基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为:中国债券综合全价指数。

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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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 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

6.4.4.1 除6.4.5.2所述会计估计变更外,本基金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。分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期所采用的会计估计发生变更。

会计估计变更主要内容为:根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年1 季度固定收益品种的估值处理标准 》以下简称"《估值处理标准》"的有关规定,经与相关托管银行、会计师事务所协商一致,自2015年3月25日起,对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种主要采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值,《估值处理标准》另有规定的除外。于2015年3月25日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2) 对证券投资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,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税;对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%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,暂不征收企业所得税。

4) 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。

5) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	27,391,137.47
定期存款	-
其中:存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计:	27,391,137.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2015年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		27,960,000.00	29,820,000.00	1,860,000.00
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,816,810,099.43	1,918,186,809.10	101,376,709.67
	银行间市场	1,096,611,487.75	1,120,519,500.00	23,908,012.25
	合计	2,913,421,587.18	3,038,706,309.10	125,284,721.92
资产支持证券		109,310,508.22	109,310,508.22	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,050,692,095.40	3,177,836,817.32	127,144,721.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注:本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注:本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注:本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	2,078.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,792.76
应收债券利息	72,468,321.96
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借罚息	-
其他	1,383,250.96
合计	73,795,444.38

6.4.7.6 其他资产

注:本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,411.22
银行间市场应付交易费用	13,698.07
合计	19,109.29

6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	108,177.14
合计	108,177.14

6.4.7.9 实收基金

金额单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,237,092,005.54	3,237,092,005.54
本期申购	939,842,934.35	939,842,934.35
本期赎回(以"-"号填列)	-2,266,264,485.44	-2,266,264,485.44
本期末	1,910,670,454.45	1,910,670,454.45

注:1、申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

2、本基金合同于2014年3月13日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币3,236,668,683.95元,折合3,236,668,683.95份基金份额。募集资金在募集期间产生的活期存款利息为人民币423,321.59元,折合423,321.59份基金份额。以上收到的实收基金(本息)共计人民币3,237,092,005.54元,折合3,237,092,005.54份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	181,074,414.46	149,203,678.09	330,278,092.55
本期利润	158,287,539.75	-22,058,956.17	136,228,583.58
本期基金份额交易产生的变动数	-10,235,074.44	-56,322,083.80	-66,557,158.24
其中:基金申购款	14,015,313.75	39,357,025.97	53,372,339.72
基金赎回款	-24,250,388.19	-95,679,109.77	-119,929,497.96
本期已分配利润	-226,596,463.27	-	-226,596,463.27
本期末	102,530,416.30	70,822,638.12	173,353,054.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	203,572.85
定期存款利息收入	17,626,390.51
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	154,990.73
其他	3,655.26
合计	17,988,609.35

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益--买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	10,601,919.50
减:卖出股票成本总额	10,361,798.92
买卖股票差价收入	240,120.58

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益--买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	58,250,974.76
债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	58,250,974.76

6.4.7.13.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	2,416,113,798.53
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	2,268,099,268.27
减:应收利息总额	89,763,555.52
买卖债券差价收入	58,250,974.76

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	164,685,894.39
减:卖出资产支持证券成本总额	157,700,077.81
减:应收利息总额	5,165,310.83
资产支持证券投资收益	1,820,505.75

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注:本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

注:本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益--其他投资收益

注:本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注:本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-22,058,956.17
--股票投资	1,860,000.00
--债券投资	-23,918,956.17
--资产支持证券投资	-
--贵金属投资	-
--其他	-
2.衍生工具	-
--权证投资	-
3.其他	-
合计	-22,058,956.17

6.4.7.18 其他收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	13,257.48
其他	60,600.00
合计	73,857.48

6.4.7.19 交易费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	27,228.34
银行间市场交易费用	9,125.00
合计	36,353.34

6.4.7.20 其他费用

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	49,588.57
账户服务费	27,400.00